

NEUBERGER BERMAN



NEUBERGER BERMAN INVESTMENT FUNDS PLC JAHRESBERICHT 2023

GEPRÜFTER JAHRESABSCHLUSS
FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

Inhaltsverzeichnis

| | SEITE |
|--|-------|
| GESCHÄFTSFÜHRUNG UND VERWALTUNG | 1 |
| INFORMATIONEN | 4 |
| BERICHT DER ALLGEMEINE DIREKTOREN | 45 |
| BERICHT DER VERWAHRSTELLE AN DIE ANTEILINHABER | 51 |
| BERICHT DER UNABHÄNGIGEN WIRTSCHAFTSPRÜFER AN DIE GESELLSCHAFTER DER NEUBERGER BERMAN INVESTMENT FUNDS PLC | 52 |
| BERICHT DER UNABHÄNGIGEN WIRTSCHAFTSPRÜFER AN DIE DIREKTOREN DER NEUBERGER BERMAN INVESTMENT FUNDS PLC | 55 |
| BERICHT DES INVESTMENT-MANAGERS | 57 |
| AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS | |
| Neuberger Berman 5G Connectivity Fund (oder „5G Connectivity“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 114 |
| Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund (oder „Absolute Return Multi Strategy“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 119 |
| Neuberger Berman China A-Share Equity Fund (oder „China A-Share Equity“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 120 |
| Neuberger Berman China Bond Fund (oder „China Bond“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 122 |
| Neuberger Berman China Equity Fund (oder „China Equity“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 126 |
| Neuberger Berman Climate Innovation Fund (oder „Climate Innovation“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 129 |
| Neuberger Berman CLO Income Fund (oder „CLO Income“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 132 |
| Neuberger Berman Commodities Fund (oder „Commodities“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 137 |
| Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund (oder „Corporate Hybrid Bond“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 140 |
| Neuberger Berman Developed Market FMP – 2027 (oder „Developed Market FMP – 2027“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 145 |
| Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund (oder „Emerging Market Debt - Hard Currency“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 148 |
| Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund (oder „Emerging Market Debt - Local Currency“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 160 |
| Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (oder „Emerging Market Debt Blend“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 175 |
| Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Fund (oder „Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 200 |
| Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund (oder „Emerging Markets Equity“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 213 |

Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

| | SEITE |
|---|-------|
| Neuberger Berman Euro Bond Fund (oder „Euro Bond“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 219 |
| Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund (oder „Euro Bond Absolute Return“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 225 |
| Neuberger Berman European High Yield Bond Fund (oder „European High Yield Bond“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 232 |
| Neuberger Berman European Sustainable Equity Fund (oder „European Sustainable Equity“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 240 |
| Neuberger Berman Event Driven Fund (oder „Event Driven“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 242 |
| Neuberger Berman Global Bond Fund (oder „Global Bond“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 244 |
| Neuberger Berman Global Diversified Income FMP – 2024 Fund (oder „Global Diversified Income FMP – 2024“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 265 |
| Neuberger Berman Global Equity Megatrends Fund (oder „Global Equity Megatrends“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 268 |
| Neuberger Berman Global Flexible Credit Income Fund (oder „Global Flexible Credit Income“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 270 |
| Neuberger Berman Global High Yield SDG Engagement Fund (oder „Global High Yield SDG Engagement“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 286 |
| Neuberger Berman Global Investment Grade Credit Fund (oder „Global Investment Grade Credit“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 305 |
| Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund (oder „Global Opportunistic Bond“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 314 |
| Neuberger Berman Global Real Estate Securities Fund (oder „Global Real Estate Securities“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 334 |
| Neuberger Berman Global Sustainable Equity Fund (oder „Global Sustainable Equity“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 338 |
| Neuberger Berman Global Sustainable Value Fund (oder „Global Sustainable Value“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 340 |
| Neuberger Berman High Yield Bond Fund (oder „High Yield Bond“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 349 |
| Neuberger Berman InnovAsia 5G Fund (oder „InnovAsia 5G“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 367 |
| Neuberger Berman Japan Equity Engagement Fund (oder „Japan Equity Engagement“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 371 |
| Neuberger Berman Macro Opportunities FX Fund (oder „Macro Opportunities FX“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 375 |
| Neuberger Berman Next Generation Mobility Fund (oder „Next Generation Mobility“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 381 |
| Neuberger Berman Next Generation Space Economy Fund (oder „Next Generation Space Economy“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 385 |
| Neuberger Berman Responsible Asian Debt - Hard Currency Fund (oder „Responsible Asian Debt - Hard Currency“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 388 |

Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

| | SEITE |
|---|-------|
| Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund (oder „Short Duration Emerging Market Debt“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 396 |
| Neuberger Berman Short Duration High Yield SDG Engagement Fund (oder „Short Duration High Yield SDG Engagement“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 408 |
| Neuberger Berman Strategic Income Fund (oder „Strategic Income“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 419 |
| Neuberger Berman Sustainable Asia High Yield Fund (oder „Sustainable Asia High Yield“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 456 |
| Neuberger Berman Sustainable Emerging Market Corporate Debt Fund (oder „Sustainable Emerging Market Corporate Debt“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 460 |
| Neuberger Berman Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency Fund (oder „Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 470 |
| Neuberger Berman Tactical Macro Fund (oder „Tactical Macro“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 476 |
| Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund (oder „Ultra Short Term Euro Bond“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 479 |
| Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (oder „Uncorrelated Strategies“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 490 |
| Neuberger Berman US Equity Fund (oder „US Equity“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 641 |
| Neuberger Berman US Equity Index PutWrite Fund (oder „US Equity Index PutWrite“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 644 |
| Neuberger Berman US Large Cap Value Fund (oder „US Large Cap Value“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 647 |
| Neuberger Berman US Long Short Equity Fund (oder „US Long Short Equity“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 651 |
| Neuberger Berman US Multi Cap Opportunities Fund (oder „US Multi Cap Opportunities“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 659 |
| Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund (oder „US Real Estate Securities“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 662 |
| Neuberger Berman US Small Cap Fund (oder „US Small Cap“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 666 |
| Neuberger Berman US Small Cap Intrinsic Value Fund (oder „US Small Cap Intrinsic Value“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 671 |
| BILANZEN | 675 |
| GEWINN- UND VERLUSTRECHNUNG | 690 |
| AUFSTELLUNG ÜBER DIE ENTWICKLUNG DES AUF INHABER RÜCKZAHLBARER, GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGENS | 705 |
| AUFSTELLUNG DER WESENTLICHEN KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT) | 713 |

Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

| | SEITE |
|--|-------|
| ANMERKUNGEN ZUM GEPRÜFTEN JAHRESABSCHLUSS | 829 |
| WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE | 829 |
| Finanzvermögen und -verbindlichkeiten erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 838 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 869 |
| Kontenüberziehung | 889 |
| Anteilkapital | 889 |
| Gebühren des Managers, der Verwaltungsstelle, der Vertriebsstelle und der Verwahrstelle | 1004 |
| Honorare und Aufwendungen der Direktoren | 1028 |
| Vergütung der Abschlussprüfer | 1028 |
| Sonstige Gebühren und Kosten | 1028 |
| Transaktionen verbundener Parteien | 1029 |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten | 1048 |
| Angaben zu Finanzinstrumenten | 1077 |
| Vergleichszahlen für den Nettoinventarwert | 1240 |
| Wechselkurse | 1347 |
| Berichtigung der Währungsumrechnung | 1349 |
| Vereinbarungen über Verrechnungsprovisionen (Soft Commissions) | 1349 |
| Getrennte Haftung | 1349 |
| Effizientes Portfoliomanagement | 1349 |
| Kreditfazilität | 1350 |
| Ungedeckte Kreditzusagen | 1350 |
| Wesentliche Ereignisse während des Geschäftsjahres | 1351 |
| Wesentliche Ereignisse seit dem Ende des Geschäftsjahres | 1352 |
| Genehmigung des Abschlusses | 1353 |
| Finanzkennzahlen | 1354 |
| Derivative Kontrakte | 1518 |
| Saldierung von Finanzinstrumenten | 1539 |
| Geschlossene Fonds | 1633 |
| ANHANG I – GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) | 1634 |
| ANHANG II – PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) | 1664 |
| ANHANG III – INFORMATIONEN ÜBER DAS GESAMTRISIKO (UNGEPRÜFT) | 1690 |
| ANHANG IV – VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (UNGEPRÜFT) | 1692 |
| ANHANG V – ANGABEN ZUR VERGÜTUNG (UNGEPRÜFT) | 1708 |
| ANHANG VI – GLOSSAR DER INDIZES (UNGEPRÜFT) | 1709 |
| ANHANG VII – INVESTMENT-MANAGER, SUB-INVESTMENT-MANAGER UND UNTERBERATER (UNGEPRÜFT) | 1715 |
| ANHANG VIII – OFFENLEGUNGSVERORDNUNG (UNGEPRÜFT) | 1719 |

Geschäftsführung und Verwaltung

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

Direktoren:

Tom Finlay (Ire)** (in Ruhestand am 30. Juni 2023)

Gráinne Alexander (Irin)***

Michelle Green (Britin)*

Naomi Daly (Irin)****

Alex Duncan (Brite)*

*Nicht geschäftsführender Direktor

**Unabhängiger, nicht geschäftsführender Direktor und Vorsitzender

***Unabhängiger, nicht geschäftsführender Direktor

****Unabhängige, nicht geschäftsführende Direktorin und Vorsitzende (ab dem 1. Juli 2023)

Rechtsberater für irisches Recht:

Matheson LLP

70 Sir John Rogerson's Quay

Dublin 2

Irland

Verwahrstelle:

Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited

30 Herbert Street

Dublin 2

Irland

Manager:

Neuberger Berman Asset Management Ireland Limited

2 Central Plaza

Dame Street

Dublin 2

Irland

Vertriebsstellen und Sub-Investment-Manager:

Neuberger Berman Asia Limited

20th Floor

Jardine House

1 Connaught Place

Central Hong Kong

Neuberger Berman Singapore Pte. Limited

Stufe 15

Ocean Financial Centre

10 Collyer Quay

Singapur 049315

Vertriebsstellen und Sub-Investment-Manager (Fortsetzung):

Neuberger Berman Europe Limited

The Zig Zag Building

70 Victoria Street

London SW1E 6SQ

England

Vertriebsstelle:

Neuberger Berman BD LLC

1290 Avenue of the Americas

New York, NY 10104-0002

USA

Nicht verbundener Unterberater:

Neuberger Berman Fund Management

(China) Limited

Unit 11, 30F

No.88 Central Avenue

China (Shanghai) Pilot Free Trade Zone, 200120

Volksrepublik China

Neuberger Berman Information Consulting

(Shanghai) Limited (formerly Neuberger Berman

Investment Management (Shanghai) Limited)

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

Jing'an District, Shanghai 200041

Volksrepublik China

Verwaltungsstelle:

Brown Brothers Harriman Fund

Administration Services (Ireland) Limited

30 Herbert Street

Dublin 2

Irland

Unabhängige Wirtschaftsprüfer:

Ernst & Young

Chartered Accountants

Harcourt Centre

Harcourt Street

Dublin 2

Irland

Geschäftsführung und Verwaltung (Fortsetzung)

Vertreter in der Schweiz:****

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

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

Secretary des Fonds und eingetragener Geschäftssitz:

Matsack Trust Limited
70 Sir John Rogerson's Quay
Dublin 2
Irland

Sub-Investment-Manager:

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

Neuberger Berman Canada ULC
2 Bloor Street East Suite 2830
Toronto, ON M4W 1A8
Kanada

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

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

Hauptvertreter und Vertriebsstelle in Taiwan:

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

Nicht verbundene Unterberater:

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

Soloda Investment Advisors LLP
3rd Floor Strand Bridge House
138-142 Strand London WC2R 1HH
Großbritannien

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

Altig LLP
29 Farm Street
London W1J 5RL
Großbritannien

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

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

Alcova Asset Management LLP
(aufgelöst am 5. Oktober 2023)
21 Knightsbridge
London SW1X 7LY
Großbritannien

Sandbar Asset Management LLP
(aufgelöst am 15. Dezember 2023)
Warnford Court
14-15 Conduit Street
London W1S 2XJ
Großbritannien

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

Geschäftsführung und Verwaltung (Fortsetzung)

Nicht verbundene Unterberater (Fortsetzung):

Cipher Capital LP
(ernannt zum 23. November 2023)
400 Madison Ave, Suite 12-A
New York, NY 10017
USA

G10 Capital Limited
(ernannt zum 22. November 2023)
4th Floor
3 More London Riverside
London SE21 2AQ
Großbritannien

Nicht verbundene Unterberater (Fortsetzung):

Crabel Capital Management, LLC
10250 Constellation Blvd., Suite 2650
Los Angeles, CA 90067
USA

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

Allgemeine Informationen

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

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

Am 31. Dezember 2023 umfasste der Fonds 53 separate Anlageportfolios („Portfolios“), die jeweils mehrere Serien rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile repräsentierten. Diese werden in der nachstehenden Tabelle angegeben:

| Portfolio | Auflegungsdatum* | SFDR-Kategorie** |
|--|-------------------|------------------|
| 5G Connectivity ¹ | 8. April 2020 | Artikel 8 |
| China A-Share Equity ² | 28. Juli 2020 | Artikel 8 |
| China Bond ¹ | 28. August 2015 | Artikel 8 |
| China Equity ¹ | 14. Juli 2009 | Artikel 6 |
| Climate Innovation ² | 1. August 2023 | Artikel 8 |
| CLO Income ² | 12. Juli 2018 | Artikel 6 |
| Commodities ² | 9. Februar 2022 | Artikel 6 |
| Corporate Hybrid Bond ² | 19. November 2015 | Artikel 8 |
| Developed Market FMP – 2027 ² | 31. Juli 2023 | Artikel 8 |
| Emerging Market Debt – Hard Currency ¹ | 31. Mai 2013 | Artikel 8 |
| Emerging Market Debt – Local Currency ¹ | 28. Juni 2013 | Artikel 8 |
| Emerging Market Debt Blend ¹ | 23. April 2014 | Artikel 8 |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend ² | 10. Juli 2017 | Artikel 8 |
| Emerging Markets Equity ¹ | 4. Oktober 2010 | Artikel 8 |
| Euro Bond ² | 14. November 2018 | Artikel 8 |
| Euro Bond Absolute Return ² | 29. November 2018 | Artikel 8 |
| European High Yield Bond ¹ | 27. Juni 2014 | Artikel 8 |
| European Sustainable Equity ¹ | 24. Februar 2021 | Artikel 8 |
| Event Driven ² | 26. Oktober 2022 | Artikel 6 |
| Global Bond ¹ | 16. Juli 2012 | Artikel 8 |
| Global Diversified Income FMP – 2024 ² | 22. Juni 2020 | Artikel 8 |
| Global Equity Megatrends ¹ | 27. April 2018 | Artikel 8 |
| Global Flexible Credit Income ² | 1. Juni 2020 | Artikel 8 |
| Global High Yield SDG Engagement ² | 4. August 2016 | Artikel 8 |
| Global Investment Grade Credit ² | 1. September 2021 | Artikel 8 |
| Global Opportunistic Bond ² | 20. Dezember 2016 | Artikel 8 |
| Global Real Estate Securities ¹ | 30. Dezember 2014 | Artikel 8 |
| Global Sustainable Equity ¹ | 24. Februar 2021 | Artikel 8 |
| Global Sustainable Value ² | 18. Dezember 2014 | Artikel 8 |

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

| Portfolio | Auflegungsdatum* | SFDR-Kategorie** |
|--|-------------------|------------------|
| High Yield Bond ¹ | 3. Mai 2006 | Artikel 8 |
| InnovAsia 5G ² | 14. Juli 2021 | Artikel 8 |
| Japan Equity Engagement ² | 12. Mai 2020 | Artikel 8 |
| Macro Opportunities FX ² | 4. Dezember 2019 | Artikel 6 |
| Next Generation Mobility ¹ | 21. August 2018 | Artikel 8 |
| Next Generation Space Economy ¹ | 10. Mai 2022 | Artikel 8 |
| Responsible Asian Debt – Hard Currency ¹ | 29. Juni 2015 | Artikel 8 |
| Short Duration Emerging Market Debt ¹ | 31. Oktober 2013 | Artikel 8 |
| Short Duration High Yield SDG Engagement ¹ | 20. Dezember 2011 | Artikel 8 |
| Strategic Income ¹ | 26. April 2013 | Artikel 8 |
| Sustainable Asia High Yield ¹ | 13. Dezember 2021 | Artikel 8 |
| Sustainable Emerging Market Corporate Debt ¹ | 14. Juni 2013 | Artikel 8 |
| Sustainable Emerging Market Debt- Hard Currency ² | 19. Januar 2022 | Artikel 9 |
| Tactical Macro ² | 30. Juni 2023 | Artikel 6 |
| Ultra Short Term Euro Bond ² | 31. Oktober 2018 | Artikel 8 |
| Uncorrelated Strategies ² | 22. Mai 2017 | Artikel 6 |
| US Equity ² | 18. Dezember 2015 | Artikel 8 |
| US Equity Index PutWrite ² | 30. Dezember 2016 | Artikel 6 |
| US Large Cap Value ¹ | 20. Dezember 2021 | Artikel 8 |
| US Long Short Equity ² | 28. Februar 2014 | Artikel 8 |
| US Multi Cap Opportunities ¹ | 13. Juni 2006 | Artikel 8 |
| US Real Estate Securities ¹ | 1. Februar 2006 | Artikel 8 |
| US Small Cap ¹ | 1. Juli 2011 | Artikel 8 |
| US Small Cap Intrinsic Value ² | 30. April 2015 | Artikel 6 |

*Erster Tag des Geschäftsbetriebs.

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

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

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

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

Der Neuberger Berman Uncorrelated Trading Fund (oder „Uncorrelated Trading“), der Neuberger Berman Global High Yield Sustainable Action Fund (oder „Global High Yield Sustainable Action“), der Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund (oder „Multi-Asset Income“) und der Neuberger Berman Emerging Markets Select Equity Fund (oder „Emerging Markets Select Equity“) wurden am 24. Mai 2023, 16. Juni 2023, 6. Juli 2023 beziehungsweise 7. September 2023 aufgelöst und stehen daher nicht mehr zur Zeichnung zur Verfügung. Der Neuberger Berman Diversified Currency Fund, der Neuberger Berman Multi-Style Premia Fund, der Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund und der Neuberger Berman Global Equity Index PutWrite Fund wurden in den vorangegangenen Berichtsjahren aufgelöst und stehen daher nicht mehr zur Zeichnung zur Verfügung. Der Neuberger Berman Multi-Asset Growth Fund, der Neuberger Berman Global Equity Fund, der Neuberger Berman Absolute Alpha Fund, der Neuberger Berman Global Bond Absolute Return Fund und der Neuberger Berman China Equity Opportunities Fund wurden in den vorangegangenen Berichtsjahren aufgelöst und ihre Zulassung wurde von der Zentralbank am 19. Mai 2023 widerrufen.

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

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

Anlageziele und eine Liste der aktiven Anteilklassen der Portfolios, die zum 31. Dezember 2023 zur Anlage verfügbar waren, sind im folgenden beschrieben:

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

5G Connectivity

Das Anlageziel des 5G Connectivity (das „Portfolio“) ist die Erwirtschaftung einer durchschnittlichen Zielrendite von 3-5 % über dem MSCI All-Country World Index vor Gebühren über einen Marktzyklus (für gewöhnlich 3 Jahre).

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

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

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|---|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse AUD A ¹ | 20. Mai 2020 | AUD |
| Thesaurierende Klasse AUD I2 | 13. September 2023 | AUD |
| Thesaurierende Klasse CHF A | 1. August 2023 | CHF |
| Thesaurierende Klasse CHF I | 1. August 2023 | CHF |
| Thesaurierende Klasse CHF I2 | 13. September 2023 | CHF |
| Thesaurierende Klasse CNY A | 1. Februar 2021 | CNY |
| Thesaurierende Klasse CNY I2 | 13. September 2023 | CNY |
| Thesaurierende Klasse EUR A ¹ | 13. Mai 2020 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) | 22. April 2020 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 30. Juni 2020 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | 12. Juni 2020 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 13. September 2023 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 1. September 2020 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | 22. April 2020 | EUR |
| Thesaurierende Klasse GBP A ¹ | 15. Mai 2020 | GBP |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | 2. November 2020 | GBP |
| Thesaurierende Klasse GBP I2 | 13. September 2023 | GBP |
| Thesaurierende Klasse HKD A ¹ | 13. Mai 2020 | HKD |
| Thesaurierende Klasse HKD I2 | 13. September 2023 | HKD |
| Thesaurierende Klasse SGD A ¹ | 14. Mai 2020 | SGD |
| Thesaurierende Klasse SGD I2 | 13. September 2023 | SGD |
| Thesaurierende Klasse USD A ¹ | 4. Mai 2020 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD E | 1. Februar 2023 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I | 8. April 2020 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD I | 8. April 2020 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 10. März 2021 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I3 | 6. November 2020 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 7. Mai 2020 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD M | 2. Juni 2020 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 19. März 2021 | USD |
| Thesaurierende Klasse ZAR A ¹ | 14. Februar 2023 | ZAR |
| Thesaurierende Klasse ZAR E | 10. Februar 2023 | ZAR |

¹Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

China A-Share Equity

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

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

China Bond

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| Name der Anteilklasse | Auflegungsdatum der Anteilklasse | Währung |
|--|----------------------------------|---------|
| Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) ¹ | 4. November 2020 | CNY |
| Ausschüttende Klasse CNY I ¹ | 8. Juni 2018 | CNY |
| Thesaurierende Klasse CNY Z | 8. September 2015 | CNY |
| Thesaurierende Klasse GBP I2 | 9. Februar 2021 | GBP |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) (nicht währungsgesichert) | 12. März 2019 | SGD |
| Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) | 8. September 2015 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 29. März 2019 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD Z (nicht währungsgesichert) | 10. April 2018 | USD |

¹Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

China Equity

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

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

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

China Equity (Fortsetzung)

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

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

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

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|--|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse CHF I | 31. Juli 2015 | CHF |
| Thesaurierende Klasse EUR A ¹ | 14. Juli 2009 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 14. Juli 2009 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR Z | 3. Juni 2014 | EUR |
| Ausschüttende Klasse GBP A ¹ | 21. Mai 2015 | GBP |
| Thesaurierende Klasse SGD A ¹ | 1. Dezember 2014 | SGD |
| Thesaurierende Klasse USD A ¹ | 14. Juli 2009 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD A ¹ | 27. August 2014 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I | 14. Juli 2009 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 11. August 2014 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD M | 27. Mai 2016 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD U | 27. Juni 2014 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 1. August 2014 | USD |

¹Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

Klimainnovation

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

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

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Climate Innovation (Fortsetzung)

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

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

CLO Income

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|------------------------------|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse EUR A | 9. Juni 2022 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 12. Juli 2018 | EUR |
| Ausschüttende Klasse EUR I2 | 15. November 2018 | EUR |
| Thesaurierende Klasse GBP Z | 12. Dezember 2019 | GBP |
| Thesaurierende Klasse SEK I | 12. Juli 2018 | SEK |
| Thesaurierende Klasse USD A | 9. Juni 2022 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I | 12. Juli 2018 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD I | 17. August 2023 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD I2 | 21. März 2019 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD I5 | 12. Juli 2018 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 18. April 2019 | USD |

Commodities

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

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

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

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Commodities (Fortsetzung)

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

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

Corporate Hybrid Bond

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

Um sein Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in hybride Unternehmensanleihen, die ein Rating von Investment Grade oder unter Investment Grade aufweisen. Das Portfolio strebt die Anwendung von Grundsätzen der fundamentalen Bottom-up-Analyse bei der Auswahl der Wertpapiere zur Anlage an, d. h. die Analysen, die Neuberger Berman Investment Advisers LLC (der „Sub-Investment-Manager“) durchführt, konzentrieren sich auf die Stärken der einzelnen Wertpapiere, anstatt Wertpapiere auf Basis breiterer Themen, wie etwa nach Branchen, auszuwählen. Die Analyse der Stärke eines Wertpapiers erfolgt individuell für jedes Wertpapier statt auf Basis breiterer Themen. So wird beispielsweise das Bonitätsrating des Wertpapiers im Verhältnis zu seiner erwarteten Rendite analysiert. Das Portfolio setzt den Schwerpunkt auf Wertpapiere, die weltweit an anerkannten Märkten notiert sind oder gehandelt werden, und ist nicht an Branchen oder Sektoren gebunden. Das Portfolio kann bei seinem Engagement zwischen geografischen Regionen und Ländern sowie zwischen Sektoren und Emittenten in Abhängigkeit von den wirtschaftlichen oder regionalen Fundamentaldaten (wie etwa der Bewertung der einzelnen Wertpapiere im Vergleich zu ähnlichen Wertpapieren) rotieren. Das Portfolio kann durch seine Anlagen in nachrangigen Schuldtiteln und/oder Wertpapieren mit Ratings unter Investment Grade ein mittleres Volatilitätsniveau aufweisen.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

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

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|--|---|----------------|
| Ausschüttende Klasse GBP I2 | 24. August 2016 | GBP |
| Thesaurierende Klasse GBP P | 16. August 2019 | GBP |
| Ausschüttende Klasse GBP P | 19. Mai 2017 | GBP |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 2. August 2019 | SGD |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 18. Juli 2016 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD A | 10. August 2016 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD A | 23. April 2021 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 13. Dezember 2017 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I | 14. Juni 2016 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD I | 23. April 2021 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 3. Februar 2017 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD I2 | 3. Februar 2017 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD M | 15. Dezember 2017 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD M | 15. Dezember 2017 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD P | 5. Mai 2017 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 20. Januar 2017 | USD |

Developed Market FMP – 2027

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

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

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Emerging Market Debt – Hard Currency

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|--|---|----------------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) ¹ | 26. Februar 2019 | AUD |
| Ausschüttende Klasse AUD I | 26. Mai 2020 | AUD |
| Thesaurierende Klasse CAD I3 (nicht währungsgesichert) | 31. Oktober 2022 | CAD |
| Thesaurierende Klasse CHF I2 | 13. Januar 2020 | CHF |
| Thesaurierende Klasse CHF P | 24. Januar 2018 | CHF |
| Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) ¹ | 16. April 2018 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR A ¹ | 31. Mai 2013 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 31. Mai 2013 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | 17. September 2019 | EUR |
| Ausschüttende Klasse EUR I | 7. Oktober 2016 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 18. Dezember 2019 | EUR |
| Ausschüttende Klasse EUR I2 | 6. November 2019 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR I3 | 29. Juli 2016 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR I4 | 10. Dezember 2015 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) | 5. Juli 2022 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 18. Februar 2016 | EUR |
| Ausschüttende Klasse EUR M | 18. Februar 2016 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR P | 23. Januar 2018 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR Z | 29. Dezember 2017 | EUR |
| Thesaurierende Klasse GBP I | 16. Dezember 2016 | GBP |
| Ausschüttende Klasse GBP I | 21. Februar 2018 | GBP |
| Thesaurierende Klasse GBP I2 | 26. Januar 2018 | GBP |
| Ausschüttende Klasse GBP I2 | 6. Juli 2015 | GBP |
| Thesaurierende Klasse GBP P | 14. März 2018 | GBP |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) ¹ | 9. Januar 2019 | HKD |
| Thesaurierende Klasse JPY I | 11. Dezember 2017 | JPY |
| Thesaurierende Klasse SEK A | 5. November 2015 | SEK |
| Thesaurierende Klasse SEK I2 | 19. Mai 2021 | SEK |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) ¹ | 17. Februar 2015 | SGD |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) ¹ | 31. Oktober 2014 | USD |

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Emerging Market Debt – Hard Currency (Fortsetzung)

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|--|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse USD A ¹ | 31. Mai 2013 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD A | 30. Oktober 2020 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 24. August 2017 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I | 31. Mai 2013 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD I | 31. Mai 2013 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 15. November 2016 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD I2 | 20. April 2018 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD I3 | 20. März 2019 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD M | 25. August 2017 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD M | 15. September 2017 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD P | 11. Januar 2018 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD X | 16. Dezember 2021 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 26. April 2017 | USD |

¹Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

Emerging Market Debt – Local Currency

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|--|---|----------------|
| Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) | 4. Juni 2015 | AUD |
| Thesaurierende Klasse AUD B | 4. Juni 2015 | AUD |
| Thesaurierende Klasse AUD C2 | 4. Juni 2015 | AUD |
| Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) | 4. Juni 2015 | AUD |
| Thesaurierende Klasse AUD E | 4. Juni 2015 | AUD |
| Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) | 4. Juni 2015 | AUD |
| Thesaurierende Klasse AUD T | 4. Juni 2015 | AUD |
| Thesaurierende Klasse EUR A ¹ | 28. Juni 2013 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 28. Juni 2013 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | 27. Juni 2017 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert) | 29. Dezember 2015 | EUR |
| Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) | 14. März 2017 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR Y (nicht währungsgesichert) | 25. Januar 2021 | EUR |
| Thesaurierende Klasse GBP I | 22. September 2017 | GBP |
| Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) | 2. November 2016 | GBP |

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Emerging Market Debt – Local Currency (Fortsetzung)

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|---|---|----------------|
| Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) | 2. November 2016 | GBP |
| Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert) | 25. Januar 2021 | GBP |
| Thesaurierende Klasse SEK A | 5. November 2015 | SEK |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) ¹ | 4. März 2015 | SGD |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) ¹ | 31. Oktober 2014 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD A ¹ | 28. Juni 2013 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) | 4. Juni 2015 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD B | 4. Juni 2015 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich) | 4. Juni 2015 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) | 4. Juni 2015 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD E | 4. Juni 2015 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) | 2. September 2021 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I | 28. Juni 2013 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD I | 14. Oktober 2016 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 13. August 2014 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 26. September 2018 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) | 31. März 2016 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD T | 4. Juni 2015 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD X | 23. Oktober 2013 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD Y | 14. Januar 2021 | USD |
| Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich) | 5. Juni 2015 | ZAR |
| Thesaurierende Klasse ZAR B | 5. Juni 2015 | ZAR |
| Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich) | 5. Juni 2015 | ZAR |
| Thesaurierende Klasse ZAR C2 | 5. Juni 2015 | ZAR |
| Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) | 5. Juni 2015 | ZAR |
| Thesaurierende Klasse ZAR E | 5. Juni 2015 | ZAR |
| Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) | 5. Juni 2015 | ZAR |
| Thesaurierende Klasse ZAR T | 5. Juni 2015 | ZAR |

¹Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

Emerging Market Debt Blend

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

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|--|---|----------------|
| Ausschüttende Klasse AUD I3 | 6. November 2019 | AUD |
| Thesaurierende Klasse EUR A ¹ | 4. Dezember 2015 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 8. Juli 2014 | EUR |
| Ausschüttende Klasse EUR I | 19. Juni 2015 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 27. Mai 2014 | EUR |
| Ausschüttende Klasse EUR I2 | 24. Februar 2015 | EUR |
| Ausschüttende Klasse EUR I3 | 5. November 2019 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) | 23. März 2017 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 23. April 2014 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 29. Januar 2016 | EUR |
| Ausschüttende Klasse EUR M | 29. Januar 2016 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR Z | 2. Juni 2014 | EUR |
| Thesaurierende Klasse GBP I | 31. März 2016 | GBP |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | 12. April 2017 | GBP |
| Ausschüttende Klasse GBP I | 22. Mai 2018 | GBP |
| Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | 22. Mai 2018 | GBP |
| Thesaurierende Klasse GBP P | 13. Mai 2019 | GBP |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | 13. Mai 2019 | GBP |
| Thesaurierende Klasse GBP Z | 17. März 2016 | GBP |
| Thesaurierende Klasse NOK U | 13. März 2017 | NOK |
| Thesaurierende Klasse SEK A | 5. November 2015 | SEK |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) ¹ | 15. September 2017 | SGD |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) ¹ | 15. September 2017 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD A ¹ | 4. Februar 2016 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 24. August 2017 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I | 23. April 2014 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD I | 1. Juni 2016 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD I2 | 24. Februar 2015 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 24. Juli 2023 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD M | 25. August 2017 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD M | 26. September 2017 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 28. September 2015 | USD |

¹Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

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

Emerging Markets Equity

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

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

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| Name der Anteilklasse | Auflegungsdatum der Anteilklasse | Währung |
|--|----------------------------------|---------|
| Thesaurierende Klasse AUD B | 30. November 2016 | AUD |
| Thesaurierende Klasse AUD C2 | 30. November 2016 | AUD |
| Thesaurierende Klasse AUD E | 30. November 2016 | AUD |
| Thesaurierende Klasse AUD T | 30. November 2016 | AUD |
| Ausschüttende Klasse CAD I (nicht währungsgesichert) | 24. Januar 2018 | CAD |

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|--|---|----------------|
| Ausschüttende Klasse CAD I2 | 17. Dezember 2021 | CAD |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 4. Oktober 2010 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 18. Februar 2016 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR Z | 5. Februar 2018 | EUR |
| Thesaurierende Klasse GBP I | 15. Januar 2014 | GBP |
| Thesaurierende Klasse GBP Z | 17. März 2016 | GBP |
| Thesaurierende Klasse USD A ¹ | 4. Oktober 2010 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD B | 30. November 2016 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD C2 | 30. November 2016 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD E | 30. November 2016 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I | 4. Oktober 2010 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD M | 27. Mai 2016 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD T | 30. November 2016 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 30. Juni 2014 | USD |
| Thesaurierende Klasse ZAR B | 30. November 2016 | ZAR |
| Thesaurierende Klasse ZAR C2 | 30. November 2016 | ZAR |
| Thesaurierende Klasse ZAR E | 30. November 2016 | ZAR |
| Thesaurierende Klasse ZAR T | 30. November 2016 | ZAR |

¹Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

Euro Bond

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|------------------------------|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse EUR I | 14. November 2018 | EUR |
| Ausschüttende Klasse EUR I | 14. November 2018 | EUR |

Euro Bond Absolute Return

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

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

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Euro Bond Absolute Return (Fortsetzung)

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|------------------------------|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse EUR I | 29. November 2018 | EUR |
| Ausschüttende Klasse EUR I | 29. November 2018 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 28. März 2019 | EUR |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 22. November 2019 | USD |

European High Yield Bond

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|---|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse CHF I | 14. März 2023 | CHF |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 27. Juni 2014 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 8. November 2023 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 22. November 2023 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 29. Januar 2016 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR X | 20. Februar 2018 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR Y | 4. Januar 2023 | EUR |
| Ausschüttende Klasse EUR Y | 27. Juni 2023 | EUR |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) ¹ | 31. Oktober 2014 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I | 27. Juni 2014 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD X | 12. Januar 2018 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 26. April 2019 | USD |

¹Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

European Sustainable Equity

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

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

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

European Sustainable Equity (Fortsetzung)

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| Name der Anteilklasse | Auflegungsdatum der Anteilklasse | Währung |
|---|----------------------------------|---------|
| Ausschüttende Klasse EUR A ¹ | 12. Januar 2022 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 24. Februar 2021 | EUR |
| Ausschüttende Klasse EUR I | 24. Februar 2021 | EUR |
| Ausschüttende Klasse EUR I3 | 7. Oktober 2021 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 20. Juli 2021 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 24. Februar 2021 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR Z | 29. März 2021 | EUR |
| Thesaurierende Klasse USD A (nicht währungsgesichert) | 15. März 2021 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) | 15. März 2021 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD M (nicht währungsgesichert) | 15. März 2021 | USD |

¹Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

Event Driven

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

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

Global Bond

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

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

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

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Global Bond (Fortsetzung)

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

Der Anlage-Ansatz basiert auf vier grundlegenden differenzierenden Faktoren:

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|---|---|----------------|
| Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) | 3. Februar 2021 | AUD |
| Thesaurierende Klasse EUR I Benchmark Währungsgesicherte Klasse | 31. August 2023 | EUR |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 3. Januar 2018 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I Benchmark Währungsgesicherte Klasse | 26. September 2022 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I | 16. Juli 2012 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD M | 2. Juli 2018 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) | 3. Februar 2021 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 20. Januar 2017 | USD |
| Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) | 3. Februar 2021 | ZAR |

Global Diversified Income FMP – 2024

Das Anlageziel des Global Diversified Income FMP - 2024 (das „Portfolio“) ist die Maximierung der laufenden Erträge während der Laufzeit des Portfolios, indem in eine diversifizierte Mischung aus globalen festverzinslichen Wertpapieren, einschließlich hochverzinslicher Wertpapiere, investiert wird.

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|------------------------------|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse EUR A | 7. Juli 2020 | EUR |
| Ausschüttende Klasse EUR A | 10. Juli 2020 | EUR |
| Ausschüttende Klasse EUR I | 29. Juli 2020 | EUR |
| Ausschüttende Klasse GBP I | 22. Juni 2020 | GBP |
| Ausschüttende Klasse HKD A | 28. Juli 2020 | HKD |
| Ausschüttende Klasse SGD A | 22. Juni 2020 | SGD |

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Global Diversified Income FMP – 2024 (Fortsetzung)

| Name der Anteilklasse | Auflegungsdatum der Anteilklasse | Währung |
|-----------------------------|----------------------------------|---------|
| Thesaurierende Klasse USD A | 22. Juni 2020 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD A | 22. Juni 2020 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I | 22. Juni 2020 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD I | 22. Juni 2020 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD X | 22. Juni 2020 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD X | 22. Juni 2020 | USD |

Global Equity Megatrends

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| Name der Anteilklasse | Auflegungsdatum der Anteilklasse | Währung |
|---|----------------------------------|---------|
| Thesaurierende Klasse EUR I | 22. Dezember 2023 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | 19. Oktober 2018 | EUR |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | 5. Juli 2023 | GBP |
| Thesaurierende Klasse SGD A ¹ | 8. Dezember 2023 | SGD |
| Thesaurierende Klasse USD A ¹ | 27. April 2018 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 27. April 2018 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I | 27. April 2018 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD M | 27. April 2018 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 25. Februar 2022 | USD |

¹Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

Global Flexible Credit Income

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| Name der Anteilklasse | Auflegungsdatum der Anteilklasse | Währung |
|------------------------------|----------------------------------|---------|
| Thesaurierende Klasse CAD I5 | 18. März 2021 | CAD |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 29. September 2020 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 13. August 2020 | EUR |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 | 1. Juni 2020 | GBP |

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Global Flexible Credit Income (Fortsetzung)

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|------------------------------|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse USD A | 16. September 2020 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I | 1. Juni 2020 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD I | 1. Juni 2020 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD M | 16. September 2020 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 1. Juni 2020 | USD |

Global High Yield SDG Engagement

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

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

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

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

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

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Global Investment Grade Credit

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

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

Das Portfolio wird überwiegend in festverzinsliche Wertpapiere mit Investment-Grade-Rating investieren, die von Unternehmen emittiert werden, welche ihren Hauptsitz in OECD-Ländern haben oder den überwiegenden Teil ihrer Geschäftstätigkeit dort ausüben. Das Portfolio strebt die Anwendung von Grundsätzen der fundamentalen Bottom-up-Analyse bei der Auswahl der Wertpapiere zur Anlage an, d. h. die Analysen des Managers und des Sub-Investment-Managers konzentrieren sich auf die Stärken der einzelnen Wertpapiere, anstatt Wertpapiere auf Basis breiterer Themen, wie etwa nach Branchen, auszuwählen. So wird das Rating des Wertpapiers im Verhältnis zur vorgeschlagenen Rendite analysiert, und die Merkmale des Wertpapiers werden unter die Lupe genommen, um die Vorhersagbarkeit von Cashflows zu bestimmen. Hierzu werden Faktoren wie das Cashflow-Profil des Emittenten, die Verschuldung und der Verschuldungsgrad herangezogen. Das Portfolio wird den Schwerpunkt auf Wertpapiere legen, die weltweit an anerkannten Märkten notiert sind oder gehandelt werden, und ist nicht an Branchen oder Sektoren gebunden. Das Portfolio kann bei seinem Engagement zwischen geografischen Regionen und Ländern sowie zwischen Sektoren und Emittenten in Abhängigkeit von den wirtschaftlichen oder regionalen Fundamentaldaten (wie etwa der Bewertung der einzelnen Wertpapiere im Vergleich zu ähnlichen Wertpapieren) rotieren.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

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

Global Opportunistic Bond

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

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

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Global Real Estate Securities

Das Anlageziel des Global Real Estate Securities (das „Portfolio“) ist die Erzielung einer Gesamrendite (Total Return) insbesondere durch Kapitalzuwachs sowie aus laufenden Erträgen durch Anlagen in Wertpapieren von weltweit ansässigen Immobilienunternehmen.

Um sein Anlageziel zu erreichen, investiert das Portfolio mindestens 80 % seines Nettovermögens in Aktien aus den USA und anderen Ländern, die von Immobilienaktiengesellschaften (Real Estate Investment Trusts – „REITs“) emittiert werden, sowie in Stammaktien und andere Wertpapiere, die von anderen Immobilienunternehmen emittiert werden. Ein REIT ist ein Unternehmen, das Ertrag generierende Immobilien besitzt und in der Regel auch betreibt oder Immobilien finanziert. Das Portfolio definiert ein Immobilienunternehmen als ein Unternehmen, das mindestens 50 % seines Umsatzes aus Immobilien erzielt oder dessen Vermögen zu mindestens 50 % aus Immobilien besteht. Das Portfolio verteilt seine Vermögenswerte auf verschiedene Regionen und Länder, einschließlich der USA, ist aber stets in mindestens drei verschiedenen Ländern investiert. Das Portfolio kann auch bis zu 20 % seines Nettoinventarwerts in Aktien von Immobilienunternehmen mit Sitz in Schwellenländern investieren.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|---|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse EUR M | 29. Januar 2016 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert) | 4. November 2020 | EUR |
| Thesaurierende Klasse GBP Z | 17. März 2016 | GBP |
| Thesaurierende Klasse USD A ¹ | 9. Mai 2019 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD CI | 8. Januar 2020 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I | 30. Dezember 2014 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD I5 | 20. Dezember 2019 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD M | 2. Oktober 2019 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 13. Februar 2015 | USD |

¹Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

Global Sustainable Equity

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

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

Um dieses Ziel zu erreichen, wird das Portfolio vorwiegend in Aktien investieren, die an anerkannten Märkten weltweit notiert sind oder gehandelt werden (hierzu können auch Schwellenländer zählen) und von Unternehmen aller Marktkapitalisierungskategorien und Branchen emittiert werden. Das Portfolio wird in erster Linie in Aktien von Unternehmen investieren, deren Verhaltensweisen, Prozesse und Geschäftstätigkeiten Fortschritte auf Systemebene zur Erlangung ökologischer und sozialer Ziele bewirken, wie z. B. durch: Zugang zur Gesundheitsversorgung, nachhaltigen Konsum (d. h. die Nutzung von Produkten, Energie und Dienstleistungen mit möglichst geringen Umweltauswirkungen) sowie bewusste Verbraucher, Zugang zu Informationen und digitale Revolution, Energiewende und industrielle Innovation, Ressourceneffizienz, Entwicklung des Humankapitals, Fintech und finanzielle Inklusion (d. h. die Verfügbarkeit von Finanzdienstleistungen und Chancengleichheit beim Zugang zu derlei Dienstleistungen). Um das Anlageziel des Portfolios zu erreichen, investiert der Sub-Investment-Manager in qualitativ hochwertige Unternehmen, die (i) attraktive nachhaltige Produkte oder Dienstleistungen anbieten, (ii) bei ihrer Geschäftstätigkeit eine Verpflichtung zu Nachhaltigkeit unter Beweis stellen und (iii) wirtschaftlich wettbewerbsfähig sind, wie nachstehend detaillierter erläutert. Der Sub-Investment-Manager beabsichtigt, einen Anlageprozess zu verfolgen, der sich auf die Analyse von „Best-in-Class“-Unternehmen innerhalb eines Anlageuniversums von börsennotierten Aktien erstreckt, die von Unternehmen hauptsächlich aus Industrieländern weltweit begeben werden, und zwar sowohl in finanzieller als auch in ESG-Hinsicht (Umwelt, Soziales, Governance). Die Finanz- und ESG-Analysen werden es dem Sub-Investment-Manager ermöglichen, Unternehmen zu bewerten und identifizieren, die im Hinblick auf ihre Performance bei finanziellen und ESG-Faktoren als „Best-in-Class“ erachtet werden.

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Global Sustainable Equity (Fortsetzung)

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

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

¹Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

Global Sustainable Value

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

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| Name der Anteilklasse | Auflegungsdatum der Anteilklasse | Währung |
|--|----------------------------------|---------|
| Thesaurierende Klasse EUR M | 29. Januar 2016 | EUR |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert) | 27. September 2022 | GBP |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | 20. Oktober 2023 | GBP |
| Thesaurierende Klasse USD A | 14. August 2017 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I | 18. Dezember 2014 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I3 | 31. Mai 2022 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 24. Mai 2016 | USD |

High Yield Bond

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

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

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

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

High Yield Bond (Fortsetzung)

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|---|---|----------------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) ¹ | 5. September 2012 | AUD |
| Thesaurierende Klasse AUD A ¹ | 28. August 2012 | AUD |
| Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) | 22. Juli 2013 | AUD |
| Thesaurierende Klasse AUD B | 10. Dezember 2020 | AUD |
| Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich) | 19. Juli 2013 | AUD |
| Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) | 2. Juli 2014 | AUD |
| Thesaurierende Klasse AUD E | 2. Juli 2014 | AUD |
| Ausschüttende Klasse AUD I | 29. Dezember 2011 | AUD |
| Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) | 27. Juni 2013 | AUD |
| Ausschüttende Klasse AUD T (Wöchentlich) | 11. Juni 2013 | AUD |
| Thesaurierende Klasse AUD T | 2. August 2013 | AUD |
| Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich) ¹ | 23. Juli 2013 | CAD |
| Thesaurierende Klasse CHF A | 5. Juli 2011 | CHF |
| Thesaurierende Klasse CHF I | 27. Mai 2011 | CHF |
| Thesaurierende Klasse CHF I2 | 22. Oktober 2013 | CHF |
| Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) | 1. August 2012 | CNY |
| Ausschüttende Klasse CNY I (Monatlich) | 9. November 2012 | CNY |
| Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) ¹ | 19. Juni 2012 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR A ¹ | 3. Mai 2006 | EUR |
| Ausschüttende Klasse EUR A ¹ | 24. Februar 2012 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 9. November 2009 | EUR |
| Ausschüttende Klasse EUR I | 18. Oktober 2012 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 5. Dezember 2012 | EUR |
| Ausschüttende Klasse EUR I2 | 5. Dezember 2012 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 29. Januar 2016 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR Z | 5. November 2014 | EUR |
| Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich) ¹ | 7. Juli 2014 | GBP |
| Thesaurierende Klasse GBP A ¹ | 27. April 2011 | GBP |
| Ausschüttende Klasse GBP A ¹ | 24. Februar 2012 | GBP |
| Thesaurierende Klasse GBP I | 27. Juli 2010 | GBP |
| Ausschüttende Klasse GBP I | 8. November 2006 | GBP |
| Thesaurierende Klasse GBP I2 | 5. Dezember 2012 | GBP |
| Ausschüttende Klasse GBP I2 | 5. Dezember 2012 | GBP |
| Thesaurierende Klasse GBP Z | 17. März 2016 | GBP |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) ¹ | 14. September 2012 | HKD |
| Thesaurierende Klasse SEK A | 16. Juni 2011 | SEK |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) ¹ | 30. März 2012 | SGD |
| Thesaurierende Klasse SGD A ¹ | 9. März 2012 | SGD |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) ¹ | 2. Mai 2012 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD A (Wöchentlich) ¹ | 22. Januar 2013 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD A ¹ | 11. Januar 2010 | USD |

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

High Yield Bond (Fortsetzung)

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|--|---|----------------|
| Ausschüttende Klasse USD A ¹ | 24. Februar 2012 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) | 31. Oktober 2012 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD B | 31. Oktober 2012 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD C | 21. November 2012 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 25. Oktober 2017 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD C1 | 7. September 2017 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich) | 31. Oktober 2012 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD C2 | 31. Oktober 2012 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) | 2. Juli 2014 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD E | 2. Juli 2014 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) | 13. September 2012 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I | 3. Mai 2006 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD I | 16. November 2009 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD I2 (Monatlich) | 24. September 2015 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 5. Dezember 2012 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD I2 | 5. Dezember 2012 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich) | 1. Juni 2016 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD M | 18. Februar 2016 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD M | 1. März 2018 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD P | 9. Januar 2018 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) | 31. Oktober 2012 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD T (Wöchentlich) | 11. Juni 2013 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD T | 31. Oktober 2012 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD U (Monatlich) | 2. Mai 2013 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD U | 9. Oktober 2012 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 2. Mai 2014 | USD |
| Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich) | 11. Juni 2013 | ZAR |
| Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich) | 11. Juni 2013 | ZAR |
| Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) | 2. Juli 2014 | ZAR |
| Thesaurierende Klasse ZAR E | 2. Juli 2014 | ZAR |
| Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) | 11. Juni 2013 | ZAR |
| Thesaurierende Klasse ZAR T | 19. Dezember 2016 | ZAR |

¹Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

InnovAsia 5G

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

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

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

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

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

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

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Japan Equity Engagement

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|--|---|----------------|
| Ausschüttende Klasse EUR I5 | 10. Februar 2022 | EUR |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 | 22. September 2021 | GBP |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert) | 6. Juli 2023 | GBP |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | 11. November 2021 | GBP |
| Thesaurierende Klasse JPY I | 12. Mai 2020 | JPY |
| Ausschüttende Klasse JPY I | 12. Mai 2020 | JPY |
| Thesaurierende Klasse JPY I5 | 16. Februar 2021 | JPY |
| Thesaurierende Klasse JPY Z | 28. April 2021 | JPY |

Macro Opportunities FX

Das Anlageziel des Macro Opportunities FX (das „Portfolio“) ist die Erwirtschaftung einer durchschnittlichen Zielrendite von 5-6 % über dem Geldmarkt vor Gebühren über einen Marktzyklus (für gewöhnlich 3 Jahre).

Das Portfolio strebt danach, sein Anlageziel zu erreichen, indem es:

- als Erstes Long- und Short-Engagements in einer Reihe globaler liquider Währungen eingeht, vorwiegend – aber nicht darauf beschränkt – in G10-Währungen und opportunistisch in den liquidesten Schwellenländerwährungen (dies sind für gewöhnlich die am stärksten gehandelten Währungen, z. B. der brasilianische Real, der Singapur-Dollar und der südkoreanische Won) mittels einer Auswahl derivativer Finanzinstrumente; und
- Zweitens, durch Anlagen in weltweiten festverzinslichen Schuldtiteln und kurzfristigen, auf Euro lautenden Anleihen, um opportunistisch die Barrenditen zu steigern und um für Liquidität und Sicherheitendeckung für Engagements zu sorgen, die durch den Einsatz derivativer Finanzinstrumente (wie weiter oben beschrieben) entstanden sind.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|------------------------------|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse EUR I | 4. Dezember 2019 | EUR |
| Thesaurierende Klasse GBP Z | 4. Dezember 2019 | GBP |
| Thesaurierende Klasse SEK I | 11. Dezember 2019 | SEK |
| Ausschüttende Klasse SEK I | 20. Oktober 2021 | SEK |
| Thesaurierende Klasse USD I | 4. Dezember 2019 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 4. Dezember 2019 | USD |

Next Generation Mobility

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

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

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Next Generation Mobility (Fortsetzung)

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

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

¹Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

Next Generation Space Economy

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

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

Responsible Asian Debt – Hard Currency

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|---|---|----------------|
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) ¹ | 30. Juni 2015 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD A ¹ | 30. Juni 2015 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 15. Oktober 2019 | USD |

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Responsible Asian Debt – Hard Currency (Fortsetzung)

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

¹Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

Short Duration Emerging Market Debt

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

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|---|---|----------------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) ¹ | 31. August 2016 | AUD |
| Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich) ¹ | 6. November 2015 | CAD |
| Thesaurierende Klasse CHF A | 6. Juni 2014 | CHF |
| Ausschüttende Klasse CHF A | 6. Juni 2014 | CHF |
| Thesaurierende Klasse CHF I | 6. Juni 2014 | CHF |
| Ausschüttende Klasse CHF I | 13. Juni 2014 | CHF |
| Thesaurierende Klasse CHF I2 | 20. Februar 2015 | CHF |
| Ausschüttende Klasse CHF I2 | 18. April 2017 | CHF |
| Thesaurierende Klasse CHF I5 | 31. März 2014 | CHF |
| Thesaurierende Klasse CHF P | 25. April 2017 | CHF |
| Thesaurierende Klasse EUR A ¹ | 13. Juni 2014 | EUR |
| Ausschüttende Klasse EUR A | 6. Juni 2014 | EUR |

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|---|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse EUR I | 6. Juni 2014 | EUR |
| Ausschüttende Klasse EUR I | 6. Juni 2014 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 23. Juni 2014 | EUR |
| Ausschüttende Klasse EUR I2 | 30. März 2017 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 14. März 2014 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 29. Januar 2016 | EUR |
| Ausschüttende Klasse EUR M | 29. Januar 2016 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR P | 23. Februar 2017 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR U | 6. Juni 2018 | EUR |
| Ausschüttende Klasse EUR X | 16. März 2020 | EUR |
| Thesaurierende Klasse GBP A ¹ | 22. November 2016 | GBP |
| Thesaurierende Klasse GBP I | 16. Dezember 2016 | GBP |
| Ausschüttende Klasse GBP I | 20. Februar 2018 | GBP |
| Thesaurierende Klasse GBP I2 | 30. September 2016 | GBP |
| Ausschüttende Klasse GBP I2 | 19. Oktober 2017 | GBP |
| Ausschüttende Klasse GBP I5 | 11. April 2014 | GBP |
| Thesaurierende Klasse GBP P | 13. August 2019 | GBP |
| Thesaurierende Klasse JPY I | 23. Februar 2015 | JPY |
| Ausschüttende Klasse JPY I | 22. September 2014 | JPY |
| Thesaurierende Klasse SEK A | 2. Februar 2018 | SEK |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) ¹ | 31. Oktober 2014 | SGD |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) ¹ | 31. Oktober 2014 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD A ¹ | 6. Dezember 2013 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD A | 6. Juni 2014 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 29. August 2017 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD C1 | 29. August 2017 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I | 31. Oktober 2013 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD I | 2. Juni 2016 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 12. September 2014 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD I2 | 30. Oktober 2015 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 19. März 2014 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD I5 | 9. Oktober 2014 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD M | 24. August 2017 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD M | 29. August 2017 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD P | 10. August 2015 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 1. April 2014 | USD |

¹Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Short Duration High Yield SDG Engagement

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

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

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|---|---|----------------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) ¹ | 11. Juni 2013 | AUD |
| Thesaurierende Klasse CHF A | 9. März 2012 | CHF |
| Thesaurierende Klasse CHF I | 20. Dezember 2011 | CHF |
| Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) | 1. August 2012 | CNY |
| Thesaurierende Klasse EUR A ¹ | 20. Dezember 2011 | EUR |
| Ausschüttende Klasse EUR A ¹ | 14. Februar 2014 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 20. Dezember 2011 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 5. Dezember 2012 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 29. Januar 2016 | EUR |
| Ausschüttende Klasse EUR M | 29. Januar 2016 | EUR |
| Thesaurierende Klasse GBP I | 17. Januar 2012 | GBP |
| Ausschüttende Klasse GBP I | 20. Dezember 2011 | GBP |
| Thesaurierende Klasse GBP I2 | 5. Dezember 2012 | GBP |
| Ausschüttende Klasse GBP I2 | 5. Dezember 2012 | GBP |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) | 21. September 2022 | HKD |
| Thesaurierende Klasse JPY I | 28. März 2012 | JPY |
| Ausschüttende Klasse JPY I | 19. Oktober 2022 | JPY |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) ¹ | 17. Januar 2014 | SGD |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) ¹ | 22. Januar 2014 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD A ¹ | 20. Dezember 2011 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD A ¹ | 30. November 2012 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 2. Oktober 2017 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I | 20. Dezember 2011 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD I | 9. Januar 2012 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 5. Dezember 2012 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD I2 | 5. Dezember 2012 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I4 | 10. Mai 2023 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 8. September 2022 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD M | 25. August 2017 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD M | 20. Dezember 2017 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 1. April 2014 | USD |

¹Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Strategic Income

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|---|---|----------------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) ¹ | 15. September 2017 | AUD |
| Ausschüttende Klasse AUD Z (Monatlich) | 1. Juli 2019 | AUD |
| Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) ¹ | 31. Mai 2023 | CNY |
| Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) ¹ | 7. August 2017 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR A ¹ | 14. November 2022 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 22. Januar 2016 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 29. Januar 2016 | EUR |
| Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich) ¹ | 15. September 2017 | GBP |
| Ausschüttende Klasse GBP I (Monatlich) | 6. Dezember 2023 | GBP |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) ¹ | 15. September 2017 | HKD |
| Thesaurierende Klasse JPY I | 26. April 2013 | JPY |
| Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert) | 26. April 2013 | JPY |
| Ausschüttende Klasse JPY I CG | 10. August 2015 | JPY |
| Ausschüttende Klasse JPY I | 25. Juni 2014 | JPY |
| Thesaurierende Klasse JPY Z | 1. April 2022 | JPY |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) ¹ | 31. Oktober 2014 | SGD |
| Thesaurierende Klasse SGD A ¹ | 15. September 2017 | SGD |
| Ausschüttende Klasse SGD I (Monatlich) | 4. Juni 2018 | SGD |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) ¹ | 31. Oktober 2014 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD A ¹ | 11. Februar 2015 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD A | 10. August 2016 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 25. August 2017 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I | 26. April 2013 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD I | 10. Dezember 2014 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD M | 18. Februar 2016 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD M | 25. August 2017 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 30. Juni 2014 | USD |

¹Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Sustainable Asia High Yield

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

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

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

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

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

- eine geringe CO₂-Emissionsintensität aufweisen. Das Portfolio strebt eine Reduzierung der CO₂-Emissionen von mindestens 30 % gegenüber dem breiteren Anlageuniversum asiatischer Hochzinsanleihen an, das durch den JPMorgan Asian Credit High Yield Index (der „Index“) repräsentiert wird; und
- bessere ESG-Praktiken (Umwelt, Soziales und Governance) unter Beweis stellen. Das Portfolio strebt, basierend auf den ESG-Bewertungen eines etablierten externen Anbieters, eine höhere ESG-Bewertung als das breitere Universum asiatischer Hochzinsanleihen an, das durch den Index repräsentiert wird.

Das Ziel einer geringeren CO₂-Emissionsintensität soll dazu dienen, die langfristigen Ziele des Pariser Übereinkommens in Bezug auf die globale Erwärmung zu erreichen.

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|---|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse EUR X | 28. Januar 2022 | EUR |
| Thesaurierende Klasse GBP X | 8. April 2022 | GBP |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) ¹ | 13. Dezember 2021 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD A ¹ | 13. Dezember 2021 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I | 13. Dezember 2021 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 21. Januar 2022 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD Z | 22. März 2022 | USD |

¹Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Sustainable Emerging Market Corporate Debt

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

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

¹Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency

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

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

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

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

Tactical Macro

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|------------------------------|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse USD I | 30. Juni 2023 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 30. Juni 2023 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 30. Juni 2023 | USD |

Ultra Short Term Euro Bond

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

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

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Uncorrelated Strategies

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

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

US Equity

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|------------------------------|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse JPY I3 | 1. März 2022 | JPY |
| Thesaurierende Klasse USD A | 27. März 2020 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I | 18. Dezember 2015 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD I | 18. Dezember 2015 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD M | 9. Februar 2022 | USD |

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

US Equity Index PutWrite

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|--|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse EUR I | 13. Februar 2017 | EUR |
| Ausschüttende Klasse EUR I3 | 3. Dezember 2021 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR I4 | 28. April 2017 | EUR |
| Ausschüttende Klasse EUR I4 | 15. Dezember 2023 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 13. Februar 2017 | EUR |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | 2. März 2017 | GBP |
| Thesaurierende Klasse GBP I3 | 11. Mai 2021 | GBP |
| Ausschüttende Klasse GBP I3 | 3. Dezember 2021 | GBP |
| Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert) | 21. Juni 2023 | GBP |
| Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) | 25. Oktober 2017 | GBP |
| Ausschüttende Klasse GBP I4 | 29. November 2023 | GBP |
| Ausschüttende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | 25. August 2021 | GBP |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 15. August 2017 | SGD |
| Thesaurierende Klasse USD A | 23. Januar 2017 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) | 18. Mai 2017 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I | 30. Dezember 2016 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD I3 | 3. Dezember 2021 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I4 | 28. April 2017 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD M | 13. Februar 2017 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 10. Februar 2017 | USD |

US Large Cap Value

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|--|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse EUR A ¹ | 19. Oktober 2022 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) | 21. Juni 2022 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 30. März 2022 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | 19. April 2022 | EUR |
| Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) | 22. März 2022 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) | 27. Januar 2022 | EUR |
| Thesaurierende Klasse GBP I | 22. November 2022 | GBP |

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

US Large Cap Value (Fortsetzung)

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

¹Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

US Long Short Equity

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

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

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

US Multi Cap Opportunities

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|---|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse AUD E | 2. Juli 2014 | AUD |
| Thesaurierende Klasse AUD T | 19. Dezember 2016 | AUD |
| Thesaurierende Klasse EUR I3 | 21. März 2013 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 29. Januar 2016 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR1 A | 28. Juni 2012 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR1 I | 28. Juni 2012 | EUR |
| Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert) | 6. November 2017 | GBP |
| Thesaurierende Klasse SGD A ¹ | 16. Juli 2013 | SGD |
| Thesaurierende Klasse USD B | 22. November 2013 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 13. Oktober 2017 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD C2 | 22. November 2013 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD E | 2. Juli 2014 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 24. Mai 2023 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I3 | 29. April 2013 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD I3 | 30. Juli 2013 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD M | 18. Februar 2016 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD T | 22. November 2013 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD U | 22. Januar 2013 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 2. Mai 2014 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD1 A | 29. Juni 2012 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD1 I | 28. Juni 2012 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD1 I | 29. Juni 2012 | USD |
| Thesaurierende Klasse ZAR B | 13. Januar 2014 | ZAR |
| Thesaurierende Klasse ZAR C2 | 13. Januar 2014 | ZAR |
| Thesaurierende Klasse ZAR E | 2. Juli 2014 | ZAR |
| Thesaurierende Klasse ZAR T | 13. Januar 2014 | ZAR |

¹Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

US Real Estate Securities

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

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|---|---|----------------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) ¹ | 8. August 2016 | AUD |
| Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) | 16. August 2016 | AUD |
| Thesaurierende Klasse AUD B | 19. August 2015 | AUD |
| Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) | 16. August 2016 | AUD |
| Thesaurierende Klasse AUD E | 2. Juli 2014 | AUD |
| Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) | 13. Oktober 2015 | AUD |
| Thesaurierende Klasse AUD T | 16. Juli 2013 | AUD |
| Thesaurierende Klasse CHF A | 11. Oktober 2012 | CHF |
| Thesaurierende Klasse EUR A ¹ | 1. Februar 2006 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 1. Februar 2006 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 29. Januar 2016 | EUR |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) ¹ | 28. Juli 2016 | HKD |
| Thesaurierende Klasse SGD A ¹ | 28. Mai 2013 | SGD |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) ¹ | 18. November 2015 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD A ¹ | 1. Februar 2006 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD A ¹ | 21. März 2012 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) | 15. August 2016 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD B | 16. Juli 2013 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 31. August 2017 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) | 15. August 2016 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD E | 2. Juli 2014 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) | 19. November 2019 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I | 1. Februar 2006 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD I | 14. Februar 2013 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 5. Dezember 2012 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD M | 18. Februar 2016 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) | 31. Dezember 2015 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD T | 16. Juli 2013 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 10. Februar 2015 | USD |
| Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich) | 16. August 2016 | ZAR |
| Thesaurierende Klasse ZAR B | 13. März 2015 | ZAR |
| Thesaurierende Klasse ZAR C2 | 11. April 2019 | ZAR |
| Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) | 16. August 2016 | ZAR |
| Thesaurierende Klasse ZAR E | 2. Juli 2014 | ZAR |
| Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) | 11. Juni 2013 | ZAR |
| Thesaurierende Klasse ZAR T | 26. Juli 2013 | ZAR |

¹Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

US Small Cap

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

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

Zu den Faktoren bei der Ermittlung dieser Unternehmen gehören:

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|--|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse AUD B | 25. Oktober 2019 | AUD |
| Thesaurierende Klasse AUD C2 | 4. September 2018 | AUD |
| Thesaurierende Klasse AUD E | 2. Juli 2014 | AUD |
| Thesaurierende Klasse AUD T | 19. Dezember 2016 | AUD |
| Thesaurierende Klasse EUR A ¹ | 28. Juni 2016 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) ¹ | 18. September 2020 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 6. August 2013 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | 16. Oktober 2017 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert) | 24. Januar 2019 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) | 5. Mai 2022 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 4. Februar 2016 | EUR |
| Thesaurierende Klasse EUR Z | 31. März 2016 | EUR |
| Ausschüttende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert) | 29. Juli 2011 | JPY |
| Thesaurierende Klasse USD A ¹ | 5. Juli 2011 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD A ¹ | 28. November 2016 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD B | 16. Juli 2013 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD C2 | 16. Juli 2013 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD E | 2. Juli 2014 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I | 1. Juli 2011 | USD |
| Ausschüttende Klasse USD I | 10. Dezember 2013 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD I3 | 30. Juli 2018 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD M | 18. Februar 2016 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD T | 16. Juli 2013 | USD |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 30. August 2016 | USD |
| Thesaurierende Klasse ZAR E | 8. August 2017 | ZAR |
| Thesaurierende Klasse ZAR T | 19. Dezember 2016 | ZAR |

¹Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

US Small Cap Intrinsic Value

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

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

Bericht der Direktoren

Die Direktoren legen hiermit ihren Jahresbericht und den geprüften Jahresabschluss der Neuberger Berman Investment Funds plc (der „Fonds“) für das Geschäftsjahr zum Freitag, 31. Dezember 2023 sowie Vergleichszahlen für das Geschäftsjahr zum Donnerstag, 31. Dezember 2022 vor.

Aufgaben der Direktoren

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

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

Bei der Erstellung dieses Abschlusses müssen die Direktoren:

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

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

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

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

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

Erklärung zu maßgeblichen Prüfungsinformationen

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

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

Entsprechenserklärung der Direktoren

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

Bericht der Direktoren (Fortsetzung)

Geschäftsbücher

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

Hauptgeschäftstätigkeit und Überblick über das Geschäft

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

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

Am 31. Dezember 2023 bestanden dreiundfünfzig Portfolios, die im Abschnitt Allgemeine Informationen dieses Jahresberichts aufgeführt sind.

Ergebnisse für das Geschäftsjahr sowie Aktiva, Passiva und Geschäftslage zum 31. Dezember 2023

Ein detaillierter Jahresrückblick und ein Rückblick auf die Faktoren, die im abgelaufenen Jahr zur Performance beigetragen haben, sind in den Berichten des Investment-Managers enthalten. Details zu den Aktiva, Passiva und der Geschäftslage des Fonds und den Ergebnissen für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 sind in der Bilanz und der Gewinn- und Verlustrechnung für jedes Portfolio enthalten.

Direktoren

Die Namen und Nationalitäten der Personen, die zu irgendeinem Zeitpunkt im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 als Direktoren fungierten, sind nachstehend aufgeführt:

| | |
|--|--------|
| Tom Finlay** (in Ruhestand am 30. Juni 2023) | Ire |
| Gráinne Alexander*** | Irin |
| Michelle Green* | Britin |
| Naomi Daly**** | Irin |
| Alex Duncan* | Brite |

*Nicht geschäftsführender Direktor

**Unabhängiger, nicht geschäftsführender Direktor und Vorsitzender

***Unabhängiger, nicht geschäftsführender Direktor

****Unabhängige, nicht geschäftsführende Direktorin und Vorsitzende (ab dem 1. Juli 2023)

Beteiligungen der Direktoren und des Secretary des Fonds

Zum 31. Dezember 2023 sind Michelle Green und Alex Duncan Direktoren des Fonds und sind auch bei der Neuberger Berman Europe Limited („NBEL“), dem Sub-Investment-Manager und der Vertriebsstelle des Fonds, angestellt. Bis zum 15. Februar 2023 war Michelle Green auch Direktorin von NBAMIL, dem Manager der Gesellschaft. Frau Gráinne Alexander ist zudem Direktorin von NBAMIL.

Weder die Direktoren noch der Secretary des Fonds noch deren Familienangehörige halten oder hielten am 31. Dezember 2023 oder während des Geschäftsjahres ein wirtschaftliches Eigentum am Fonds. (2022: null).

Transaktionen unter Beteiligung von Direktoren

Im Berichtsjahr zum 31. Dezember 2023 gab es zu keinem Zeitpunkt Verträge oder Vereinbarungen von Bedeutung mit Bezug zum Geschäft des Fonds, an denen Direktoren oder der Secretary des Fonds im Sinne der Definition des Companies Act 2014 (in ihrer geltenden Fassung) beteiligt gewesen wären, mit Ausnahme der in Anmerkung 10 dieses Jahresabschlusses offengelegten.

Bericht der Direktoren (Fortsetzung)

Transaktionen unter Beteiligung von Direktoren (Fortsetzung)

Verbundene Personen

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

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

Politische Spenden

Im zum 31. Dezember 2023 endenden Jahr wurden keine politischen Spenden geleistet (2022: null).

Risikomanagementziele und -strategien

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

Ausschüttungen und Einbehaltung

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

Zukünftige Entwicklungen

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

Sonstige Sachverhalte

Die Invasion der Ukraine durch Russland und die damit zusammenhängenden Ereignisse Ende Februar 2022 haben nachteilige Auswirkungen auf Rohstoffe und die europäische Konjunktur gehabt und dies könnte weiterhin der Fall sein. Auch wenn das direkte Engagement des Fonds in Russland und der Ukraine begrenzt ist, wird die Neuberger Berman Group LLC („Neuberger Berman“), die Muttergesellschaft der Neuberger Berman Asset Management Ireland Limited („NBAMIL“), weiterhin potenzielle Auswirkungen auf die Aktivitäten des Fonds überwachen, insbesondere die erhobenen russischen Sanktionen und der Anstieg bei den damit verbundenen makroökonomischen und geopolitischen Risiken.

Der Krieg zwischen Israel und den Hamas begann im Oktober 2023 und wird weiter auf potenzielle Auswirkungen auf die Aktivitäten des Fonds überwacht werden. Das Engagement des Fonds in Israel ist und bleibt unwesentlich.

Prüfungsausschuss

Der Fonds hat einen Prüfungsausschuss gegründet. Gráinne Alexander, Naomi Daly und Alex Duncan sind Direktoren des Fonds und gehören dem Prüfungsausschuss an. Zudem wurde am 17. August 2023 Herr John M. McGovern in den Prüfungsausschuss ernannt.

Wichtige Ereignisse während des Geschäftsjahres

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

Wesentliche Ereignisse seit dem Ende des Geschäftsjahres

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

Unabhängige Wirtschaftsprüfer

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

Um die Qualität und Effektivität der von den amtierenden Abschlussprüfern erbrachten Leistungen mit denen anderer Wirtschaftsprüfungsgesellschaften zu vergleichen, führte der Fonds vor kurzem ein Ausschreibungsverfahren für die Bestellung seines externen Abschlussprüfers durch, das in der Wiederbestellung von Ernst & Young zum externen Abschlussprüfer des Fonds resultierte.

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

Bericht der Direktoren (Fortsetzung)

Corporate Governance

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

Prozess der Finanzberichterstattung – Beschreibung der wichtigsten Merkmale

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

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

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

Risikobeurteilung

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

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

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

Kontrolltätigkeiten

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

Vielfalt

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

Informationen und Kommunikation

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

Bericht der Direktoren (Fortsetzung)

Corporate Governance (Fortsetzung)

Überwachung

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

Kapitalstruktur

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

Befugnisse der Direktoren

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

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

Versammlungen der Anteilhaber

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

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

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

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

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

Zusammensetzung und Tätigkeit der Direktoren und ihrer Ausschüsse

Zurzeit gibt es 4 Direktoren, die alle nicht geschäftsführende Direktoren sind. Frau Michelle Green ist Direktorin des Fonds und war bis 15. Februar 2023 auch bei der NBAMIL, dem Manager des Fonds, angestellt. Frau Gráinne Alexander ist zudem Direktorin von NBAMIL. Die Satzung sieht keine Ablösung der Direktoren durch Rotation vor. Die Direktoren können jedoch von den Anteilhabern durch einfachen Mehrheitsbeschluss gemäß dem im Irish Companies Act von 2014 (in ihrer geltenden Fassung) festgelegten Verfahren abberufen werden. Die Direktoren kommen mindestens einmal pro Quartal zusammen. Abgesehen vom Prüfungsausschuss gibt es keine dauerhaft autorisierten Unterausschüsse der Direktoren.

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

Bericht der Direktoren (Fortsetzung)

Corporate Governance (Fortsetzung)

Unternehmensführungskodex (Corporate Governance Code) der Irish Funds

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

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

Im Namen der Direktoren

Direktor:

Naomi Daly

Direktor:

Gráinne Alexander

Datum: 17. April 2024

Datum: 17. April 2024

Bericht der Verwahrstelle an die Anteilhaber

In unserer Eigenschaft als Verwahrstelle des Fonds haben wir das Geschäftsverhalten der Neuberger Berman Investment Funds plc (der „Fonds“) in dem am 31. Dezember 2023 geendeten Geschäftsjahr überprüft.

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

Aufgaben der Verwahrstelle

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

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

Grundlage des Prüfvermerks der Verwahrstelle

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

Prüfvermerk

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

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

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

Datum: 17. April 2024

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

Bericht über die Prüfung des Jahresabschlusses

Prüfvermerk

Wir haben den Jahresabschluss der Neuberger Berman Investment Funds Plc (die „Gesellschaft“) für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr geprüft, der aus den Bilanzen, den Gewinn- und Verlustrechnungen, den Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens und den Anmerkungen zum Jahresabschluss besteht, einschließlich der in Anmerkung 1 beschriebenen Zusammenfassung der Bilanzierungsgrundsätze. Der bei der Aufstellung angewandte Rahmen für die Finanzberichterstattung umfasst irisches Recht und FRS 102, den im Vereinigten Königreich und der Republik Irland anzuwendenden Rechnungslegungsstandard, herausgegeben im Vereinigten Königreich vom Financial Reporting Council.

Unserer Meinung nach:

- vermittelt der Jahresabschluss ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild von den Aktiva und Passiva und von der Geschäftslage des Fonds zum 31. Dezember 2023 und seinem Verlust für das dann beendete Geschäftsjahr;
- wurde dieser Jahresabschluss ordnungsgemäß im Einklang mit FRS 102: „The Financial Reporting Standard applicable in the UK and Republic of Ireland“ erstellt; und
- wurde dieser Jahresabschluss ordnungsgemäß in Einklang mit den Vorschriften des Companies Act von 2014, den Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren betreffend) von 2011 und den Central Bank (Supervision and Enforcement Act) 2013 (Section 48(1)) (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations von 2019 erstellt.

Grundlage für das Testat

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

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

Feststellungen zur Unternehmensfortführung

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

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

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

Sonstige Informationen

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

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

Sonstige Informationen (Fortsetzung)

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

Wir haben diesbezüglich keine Angaben zu machen.

Vom Companies Act von 2014 vorgeschriebene Stellungnahmen zu sonstigen Sachverhalten

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

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

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

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

Angelegenheiten, über die wir im Ausnahmefall berichten müssen

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

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

Jeweilige Aufgaben

Aufgaben der Direktoren im Hinblick auf den Jahresabschluss

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

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

Aufgaben des Wirtschaftsprüfers im Hinblick auf die Abschlussprüfung

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

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

http://www.iaasa.ie/getmedia/b2389013-1cf6-458b-9b8f-a98202dc9c3a/Description_of_auditors_responsibilities_for_audit.pdf.

Diese Beschreibung ist Bestandteil unseres Berichts des Wirtschaftsprüfers.

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

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

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

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

Dublin

Datum: 22. April 2024

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

Die Direktoren
Neuberger Berman Investment Funds plc

Prüfvermerk

Wir haben den Jahresabschluss der Neuberger Berman Investment Funds Plc (der „Fonds“) geprüft, der aus der Bilanz zum 31. Dezember 2023, der Gewinn- und Verlustrechnung, der Aufstellung über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens für das dann beendete Geschäftsjahr und den Anmerkungen zum Jahresabschluss besteht.

Nach unserer Meinung stellt der Jahresabschluss in allen wesentlichen Aspekten die Bilanzen des Fonds zum 31. Dezember 2023 und seine Betriebsergebnisse sowie die Veränderungen des Nettovermögens gemäß den Bilanzierungsgrundsätzen, einschließlich FRS 102: „The financial reporting standard applicable in the UK and Republic of Ireland“ (in Irland allgemein anerkannte Bilanzierungsgrundsätze – irische GAAP), angemessen dar.

Grundlage für das Testat

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

Aufgaben des Managements im Hinblick auf den Jahresabschluss

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

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

Aufgaben des Wirtschaftsprüfers im Hinblick auf die Abschlussprüfung

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

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

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

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

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

Sonstige Informationen

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

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

Ernst & Young
Dublin, Irland
22. April 2024

5G Connectivity – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD 139,43 %. Der als Benchmark dienende MSCI All-Country World Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) verbuchte im selben Zeitraum ein Plus von 22,20 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Das langsamere Zinserhöhungstempo der US-Notenbank (im Folgenden auch die Federal Reserve oder Fed) führte zu einer allgemeinen Outperformance von Technologie und Wachstumswerten
- Die mit der Wiedereröffnung der chinesischen Wirtschaft nach Covid verbundenen Hoffnungen zu Beginn des Jahres schwanden, und die Stimmung verschlechterte sich angesichts einer unerwartet langsamen Erholung und begrenzter Konjunkturmaßnahmen
- Angesichts der makroökonomischen Unsicherheit, einschließlich einer Regionalbankenkrise in den USA und anhaltender weltweiter geopolitischer Spannungen waren die Märkte volatil
- Megacap-Wachstumsaktien mit einer hohen Marktkapitalisierung dominierten, und das Aufkommen von KI als Anlagethema führte zu einer Rally bei diesen Titeln

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Die Übergewichtung von Halbleitern und Software gegenüber dem Index.
 - Die Einzeltitelauswahl in den Bereichen Technologie-Hardware und -peripherie und Gesundheitswesen.
 - KI-Gewinner unter besonders leistungsstarken Anbietern von Halbleitern, Hardware und Hochgeschwindigkeitsnetzen.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Das Engagement in China.
 - Die Einzeltitelauswahl in den Bereichen interaktive Medien und Dienstleistungen sowie Nicht-Basiskonsumgüter.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das erhöhte Engagement im Halbleitersegment, aufgrund eines steigenden strategischen Werts und da die Talsohle der Zyklichkeit erreicht war.
- Das erhöhte Engagement unter Softwaretiteln aufgrund von Trends in der Unternehmensdigitalisierung.
- Das erhöhte Engagement bei Mega-Caps und ein reduziertes Engagement bei SMID-Caps angesichts der makroökonomischen Unsicherheiten.
- Die Reduzierung des Engagements in China und eine Umschichtung in Richtung Taiwan und Japan.

Während das Ende des Zinserhöhungszyklus in Sicht ist, könnte die makroökonomische Unsicherheit anhalten. Wir setzen daher weiterhin auf Qualität, sind aber für ein zyklisches Wachstum positioniert. Es herrscht nach wie vor Volatilität, sodass unser Fokus weiterhin auf Qualität und Bereichen mit einem starken Rückenwind für die Erträge bzw. einer starken vorhersehbaren Ertragsentwicklung liegt. Dabei achten wir auf unsere Bewertungsdisziplin. Das 5G-Thema wird stärker, da es zu einer nationalen Priorität wurde und die Digitalisierung der Wirtschaft unaufhörlich voranschreitet. Was die Nutznießer des beschleunigten Hochlaufs von KI und 5G, eine strategische Halbleiterindustrie, und die Verbreitung der Industrieautomatisierung und erneuerbare Energien angeht, sind wir positiv gestimmt.

China A-Share Equity – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtertragsrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse CNY I -12,31 %. Der als Benchmark dienende MSCI China A Onshore Net Index (Total Return, CNY) (der Index) verzeichnete im selben Zeitraum -9,87 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtertragsrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Der Markt für chinesische A-Aktien hat 2023 nachgegeben. Die Erwartungen auf eine Rückkehr zu schnellem Wachstum im Anschluss an die Pandemie, die zu Beginn des Jahres noch für eine Erholung gesorgt hat, wurden durch das laue Wachstum in China, ausbleibende Stimulierungsmaßnahmen seitens der Zentralregierung und die Turbulenzen auf dem chinesischen Immobilienmarkt enttäuscht.
- Die Aktivität im verarbeitenden Gewerbe nahm zu Beginn des Jahres zu, aber die PMI-Werte für das verarbeitende Gewerbe kamen im weiteren Verlauf des Jahres nicht über die Expansionsschwelle von 50 hinaus. Die staatlichen Anreize und die wirtschaftliche Unterstützung gegen Ende des Jahres änderten nur wenig an der Stimmung der Anleger, da die Konsensusmeinung vorherrschte, dass die Maßnahmen unzureichend seien.
- Energie, Kommunikationsdienste und Versorger waren die einzigen Sektoren mit Gewinnen im Jahresverlauf, während die Sektoren Immobilien, Industrie und Werkstoffe am stärksten zurückgingen.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Die Einzeltitelauswahl in den Sektoren Gesundheitswesen und Werkstoffe leistete den größten Beitrag zu den relativen Erträgen für das Jahr. Gleiches gilt für eine Untergewichtung von Werkstoffen.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Die Underperformance des Portfolios für das gesamte Jahr ging in erster Linie auf das erste Quartal zurück, als unsere Anlagedisziplin dazu geführt hat, dass wir in Sektoren wie KI unterrepräsentiert waren. Für den Rest des Jahres lag das Portfolio entweder auf einer Linie mit dem Index oder verzeichnete Outperformance.
 - Die Einzeltitelauswahl in den Bereichen Finanzen und IT sowie eine Nullallokation in Energie schaden der Wertentwicklung am meisten.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio blieb auf Binnenwachstum fokussiert durch hochwertige Unternehmen aus dem gesamten Marktkapitalisierungsspektrum.
- Wir konzentrierten uns weiterhin auf Unternehmen, die wir als „Quality Compounds“ ansehen – Aktien mit beständigen, verlässlichen hohen Eigenkapitalrenditen (ROE) aus den Bereichen Konsumgüter und Gesundheitswesen, die sich durch ein langfristiges Potenzial auszeichnen – sowie „Secular Growth Beneficiaries“, also Unternehmen, die für inländisches Wachstum positioniert sind und von langfristigen Trends und politischer Unterstützung profitieren, z. B. in der modernen Fertigung.
- Wir haben Fortschritte mit unserem hausinternen ESG-Research und ESG-Engagement gemacht und nutzen Treffen mit dem Management, um Änderungen vorzuschlagen, von denen wir längerfristige Vorteile erwarten.

Mit Blick auf die Zukunft sind wir der Ansicht, dass sich die chinesische Wirtschaft wandelt. Der Immobiliensektor gerät in den Hintergrund und die Anleger werden sich erneut auf das Potenzial für nachhaltige langfristige Renditen konzentrieren. Für das Portfolio stehen weiterhin einzelne Unternehmen mit soliden Fundamentaldaten und attraktiven Bewertungen im Mittelpunkt. Derzeit sehen wir Chancen bei Unternehmen mit hohen Dividendenausschüttungen, Unternehmen mit einem geschäftlichen Schwerpunkt auf Verbraucher im unteren und mittleren Bereich sowie bei medizinischen Dienstleistungen und Biopharma sowie Fertigungstechnologie.

China Bond – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtertragsrate für Anteile der Ausschüttenden Klasse CNY I 3,39 %. Der als Referenzindex dienende FTSE Chinese Government and Policy Bank Bond 0-1 Year Select Index (CNY Total Return (der Index) verbuchte im selben Zeitraum 2,21 %. (Die Performance für alle Anteilsklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtertragsrate erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die chinesische Wirtschaft hatte 2023, nach der Erholung im Anschluss an die Pandemie, einen konstruktiven Start. Der Optimismus über die Wiedereröffnung der Wirtschaft sollte jedoch bald schwinden. Im zweiten Quartal 2023 trübten sich die Wirtschaftsaussichten Chinas aufgrund des Gegenwinds aus dem Immobiliensektor, der schwächeren Nachfrage aus dem Ausland und des schwachen Binnenkonsums deutlich.
- Das nachlassende Wachstum wurde von den geldpolitischen Entscheidungsträgern zur Kenntnis genommen und führte zu einem Strategiewechsel in der zweiten Jahreshälfte. Die chinesische Regierung leitete verschiedene Maßnahmen zur Ankurbelung der Wirtschaft ein, u. a. zwei Senkungen des Zinssatzes für die mittelfristige Kreditfazilität durch die Europäische Zentralbank und eine große Emission von Staatsanleihen (Central Government Bonds, „CGB“) im Wert von 1 Billion RMB durch den Ständigen Ausschuss des NVK. Darüber hinaus wurden zusätzliche Maßnahmen zur Ankurbelung der Nachfrage auf dem Wohnungsmarkt und zur Beschleunigung der Ausgabe spezieller Kommunalobligationen eingeführt.
- Vor diesem makroökonomischen Hintergrund verzeichneten chinesische Staatsanleihen eine respektable Erholung, und die Anleiherenditen beendeten das Jahr nahe der Talsohlen des bisherigen Jahres. Dieser Trend spiegelte sich auch an den Onshore-Kreditmärkten wider, wobei sich die Kreditspreads deutlich verringerten.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Onshore-Unternehmensanleihen lieferten positive Beiträge, da Zinsen und Kreditspreads querbeet kräftig anstiegen.
 - Offshore-Unternehmensanleihen leisteten aufgrund des vorteilhaften Renditegefälles ebenfalls Positivbeiträge.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Zu den größten Verlustbringern zählten angesichts der beträchtlichen Abflüsse und der schlechten Anlegerstimmung unsere Onshore-Wandelanleihen.
 - Die größten Wertabzüge entfielen unter anderem auf unsere USD-Immobilienpositionen.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Wir haben die Duration im Laufe des Jahres schrittweise erhöht, vor allem bei den Zinsen. Die Rally bei den Onshore-Kreditspreads im bisherigen Jahresverlauf hat uns allerdings veranlasst, aus Bewertungssicht eine vorsichtigeren Position zu beziehen.
- Abgesehen von den knappen Onshore-Kreditspreads blieb das Zinsgefälle zwischen CNY und USD erheblich, woraus sich ein attraktives relatives Wertangebot chinesischer USD-Unternehmensanleihen ergab.

Wir sind uns bewusst, dass es der chinesischen Wirtschaft aufgrund struktureller Verlagerungen im Inland noch immer an Dynamik mangelt. Zum gegenwärtigen Zeitpunkt denken wir, dass fiskalische Maßnahmen der wichtigste Katalysator für die Wiederbelebung der nachlassenden Konjunktur sind, um die Nachfrage zu stimulieren und die Preise zu stützen. Unserer Ansicht nach ist es zwingend notwendig, dass solche fiskalischen Anstrengungen durch eine entgegenkommende Geldpolitik ergänzt werden. Wir rechnen daher mit der Möglichkeit einer weiteren geldpolitischen Lockerung im kommenden Jahr. Mit dem nun angelaufenen Schuldenumwandlungsprogramm für Kommunen zeichnet sich eine Erleichterung der fiskalischen Belastung Letzterer und eine Verbesserung der Liquiditätsbedingungen für chinesische lokale Finanzierungsplattformen (Local Government Financing Vehicles, „LGFVs“) ab.

China Equity – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtertragsrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I -22,22 %. Der als Benchmark dienende MSCI China All Shares Net Total Return Index (der Index) verzeichnete im selben Zeitraum ein Minus von 11,53 %. (Die Performance für alle Anteilsklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtertragsrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividenden erträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- 2023 war ein schwieriges Jahr für börsennotierte Offshore- und Onshore-Aktien, da die Wiedereröffnung der Wirtschaft nicht, wie vom Markt erwartet, eine starke zyklische Erholung mit sich gebracht hatte. Während sich der Inlandsreiseverkehr, die Ausgaben im Gaststättengewerbe und die Infrastrukturinvestitionen seit Anfang des Jahres verbessert haben, blieb der Wohnungsmarkt ebenso schwach wie die privaten Investitionen.
- Außerdem hielten sich die Bedenken hinsichtlich der geopolitischen Lage, der Risiken für lokalen Finanzierungsplattformen (LGFV) und des Fehlens umfassender geldpolitischer Anreize an. Die Märkte bevorzugten daher eindeutig defensive, renditestarke Sektoren wie Telekommunikation, Energie und Versorger, während andere Sektoren trotz sich verbessernder Fundamentaldaten Underperformance verzeichneten.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Zur Performance des Portfolios trugen vor allem das Gesundheitswesen (Einzeltitelauswahl in der Biotechnologie) und der Immobiliensektor (Einzeltitelauswahl) bei.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Die Performance wurde vor allem durch folgende Sektoren beeinträchtigt: Werkstoffe (Einzeltitelauswahl bei Chemikalien), Nicht-Basiskonsumgüter (Einzeltitelauswahl bei Einzelhändlern ohne Spezialisierung und Textilien/Bekleidung/Luxusgüter) und Finanzwerte (erhebliche Untergewichtung und Einzeltitelauswahl bei Banken).

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Im vergangenen Jahr stieg das Engagement des Portfolios im IT-Sektor am stärksten, und zwar von 6,36 % auf 11,60 %. Auf IT folgte der Sektor Nicht-Basiskonsumgüter, der von 23,89 % auf 25,86 % anstieg.
- Das Portfolioengagement in Werkstoffen ging unterdessen von 19,94 % auf 15,72 % zurück, gefolgt von Basiskonsumgütern, bei denen das Engagement von 10,63 % auf 7,59 % fiel.

Mit Blick auf die Zukunft bleibt unsere Sichtweise hinsichtlich der Anlagegelegenheiten konstruktiv, da sich die Regierung darauf konzentriert, hochwertiges Wachstum zu fördern und das Anlegervertrauen zu stärken. Unserer Meinung nach werden die jüngsten geldpolitischen Lockerungsmaßnahmen, zu denen auch finanzpolitische Impulse in Höhe von 1 Bio. Yuan und die Unterstützung des angeschlagenen Immobiliensektors gehören, wahrscheinlich allmählich in das System einfließen und eine breit angelegte wirtschaftliche Erholung unterstützen. Wichtiger ist noch, dass wir davon ausgehen, dass die Unternehmensgewinne die Talsohle erreichen und mit der Normalisierung der Wirtschaft im Jahr 2024 allmählich wieder attraktiv werden. Für die Kernpositionen gilt über das gesamte Portfolio hinweg, dass sich die meisten trotz der wirtschaftlichen Schwierigkeiten erfolgreich weitere Marktanteile sichern konnten. Sie sind dadurch nun besser aufgestellt, um von einer potenziellen Erholung zu profitieren, die wir für 2024 erwarten. Abschließend ist festzustellen, dass die Bewertungen nach wie vor sehr attraktiv sind. Das KGV des MSCI China All Shares Index und des CSI 300 Index beträgt 9,8x beziehungsweise 10,4x gegenüber 17,4x beziehungsweise 19,5x für den MSCI World Index und den S&P 500 Index.

Climate Innovation – Bericht des Investment-Managers

Von ihrer Auflage am 1. August 2023 bis zum Ende des Berichtszeitraums am 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtertragsrendite für Anteile der thesaurierenden Klasse USD I -3,00 %. Der als Benchmark dienende MSCI All-Country World Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) verbuchte im selben Zeitraum ein Plus von 3,98 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtertragsrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Im Anschluss an die Auflegung des Portfolios zeigten sich die globalen Aktienmärkte volatil, da die Gewinne für das zweite Quartal gemischt ausfielen und geopolitische Instabilität sowie wirtschaftliche Unsicherheiten den Ton angaben. Die US-Notenbank deutete zudem an, dass die Zinssätze noch länger hoch bleiben würden, was die Rendite der 10-jährigen US-Staatsanleihen auf ein neues 15-Jahres-Hoch trieb. Während der Druck auf die Kerninflation gering war, stiegen die Ölpreise weiter stark an, und die Trends bei den Verbraucherausgaben zeichneten ein uneinheitliches Bild.
- Die globalen Aktienmärkte erholten sich dann zum Jahresende, da die Fed nach einem raschen Zinsrückgang und ihrer Abkehr vom Slogan „höher für länger“ im Fahrwasser von günstigeren Inflationsdaten eine freundlichere Haltung einnahm. Da sich der Markt auf mögliche Zinssenkungen ab März 2024 einstellte, näherte sich der S&P 500 einem neuen Allzeithoch, während die Rendite auf die 10-jährige US-Staatsanleihe den stärksten zweimonatigen Rückgang seit 2008 verzeichnete.
- Während des Berichtszeitraums erwies sich, dass das globale Wachstum nicht synchronisiert ist: Die Vereinigten Staaten verbuchten eine im Kontext der Markterwartungen überdurchschnittlich gute und China eine unterdurchschnittliche Entwicklung.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Übergewichtung von Industrierwerten gegenüber dem Index.
 - Die Einzeltitelwahl in den Sektoren Versorger und Industrie.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Die Untergewichtung der Sektoren Finanzwerte, Energie und Kommunikationsdienste gegenüber dem Index.
 - Die Übergewichtung der Solarindustrie gegenüber dem Index.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Die Beteiligungen in der Solarbranche waren über die Bereiche Solarenergie für Privathaushalte und Solarenergie für Versorgungsunternehmen (einschließlich Installateure) diversifiziert.
- Das Engagement im Batteriesegment wurde aufgrund des sich abschwächenden Narrativs im dritten Quartal auf die Märkte für Elektrofahrzeuge in den USA und der EU reduziert.

Mit Blick auf die Zukunft sind wir der Meinung, dass das makroökonomische Umfeld unbeständig bleiben könnte, weil die Zentralbanken versuchen, die Inflation wieder auf das angestrebte Niveau zu bringen und gleichzeitig das Wirtschaftswachstum zu stützen. Dies wiederum hat Auswirkungen auf die Zinssätze. Insgesamt werden wir wahrscheinlich eine Übergewichtung von Industrierwerten beibehalten, um unsere Ansicht über die langfristigen strukturellen Wachstumschancen in diesem Sektor widerzuspiegeln. Bei den erneuerbaren Energien bleiben wir bei unserer Untergewichtung, da sich die Fundamentaldaten erst noch ändern müssen, und im Bereich der EV/EV-Batterien werden wir wohl weiter selektiv vorgehen, während wir die Nachfrage und die regulatorischen Bedingungen beobachten, um zu beurteilen, wann wir uns in diesem Bereich umfassender engagieren können.

CLO Income – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD 1 21,72 %. Der ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (der Index) rentierte im selben Zeitraum 5,12 %. (Die Performance für alle Anteilsklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Nachdem die Kreditspreads für Collateralised Loan Obligations (CLO) von höherer Qualität mit BB-Rating das Jahr 2022 im Kontext der Secured Overnight Financing Rate (SOFR)+850 abgeschlossen hatten, verengten sich die Spreads im Januar, als nachlassende Rezessionsorgen und nachgebende Inflationsindikatoren bei den Spreads für BB-CLO höherer Qualität zu einer Verengung auf fast+775 geführt hatten. Das sorgte auf dem CLO-Primärmarkt für zusätzliche Dynamik, da CLO-Manager versuchten, aus knapperen CLO-Spreads Kapital zu schlagen.
- Diese Verengung der Kreditspreads kehrte sich im Februar und März rasch wieder um, da unerwartete Wirtschaftsdaten die Spekulationen der Anleger um mögliche weitere – und vielleicht beschleunigte – Zinserhöhungen anheizten. Noch verstärkt wurden diese Sorgen im März durch Pleiten von Regionalbanken und Bedenken, die die Spreads von CLO mit BB-Rating Mitte März in den SOFR-Bereich von+900 trieben, bevor bessere Stimmung infolge von Zusicherungen der US-Regierung, den Bankensektor zu stabilisieren, Ende März und Anfang April zu einer deutlichen Verengung der Spreads führte. Diese stabilisierten sich den Mai hindurch für CLO mit BB-Rating generell im Bereich von SOFR+800 bis +825.
- Von Juni bis in den September hinein verengten sich die Spreads von CLO aus dem BB-Segment, da verschiedene Wirtschaftsdaten weiterhin auf langsamere Zinserhöhungen hinwiesen. Auch die Kredite verteuerten sich in diesem Zeitraum aufgrund der verbesserten Stimmung um etwa 2,5 Punkte und erreichten damit neue Jahreshöchststände im Kredithandel. Ende September lagen die Kreditspreads für CLOs mit BB-Rating auf dem Sekundärmarkt im Kontext von SOFR+745.
- Im vierten Quartal des Kalenderjahres verengten sich die CLO-Spreads deutlich, da die Wirtschaftsdaten und die Stellungnahmen der US-Notenbank auf eine geringere Wahrscheinlichkeit für künftige Zinserhöhungen hindeuteten und der Markt sich zunehmend auf eine „weiche Landung“ einstellte. Zum Jahresende lagen die Spreads für CLO mit BB-Rating auf dem Sekundärmarkt im SOFR-Bereich von +675.
- Zum 31. Dezember 2023 betrug ihre nennwertgewichtete Ausfallquote für die vorhergehenden zwölf Monate 1,53 % und damit 264 Basispunkte weniger als der Höchststand bei 4,17 % von September 2020. Das Volumen der Neuemissionen ging gegenüber dem Niveau von 2022 um 24 % zurück. Trotz eines schwierigeren Umfelds für Aktienarbitrage war der CLO-Primärmarkt weiterhin aktiv, da die Manager die im Vergleich zum Vorjahr engeren Kreditspreads für CLO ausnutzten.

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

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

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Während wir unser Engagement in europäischen CLOs im Berichtszeitraum nach und nach aufgestockt haben, ist das Portfolio nach wie vor überwiegend in US-Krediten engagiert: 71 % der CLO-Positionen lauten auf US-Dollar.
- Im Juni nutzten wir die Rally bei CLO, um unser Engagement in CLO zurückzufahren, deren Emission bereits länger zurücklag.

Trotz makroökonomischer und geopolitischer Bedenken vertrauen wir grundsätzlich weiterhin auf die beträchtliche strukturelle Absicherung, die gegen Kreditverluste in den zugrunde liegenden Kreditportfolios besteht. CLO-Strukturen im Allgemeinen und CLO-Schuldtitel mit BB-Rating im Besonderen haben sich angesichts einer erheblichen Rezession im Jahr 2020 einmal mehr als sehr robust erwiesen. Wir sind der Meinung, dass unser Fokus auf Anlagen in erstklassigen zugrunde liegenden Kredite zu einer Outperformance gegenüber dem allgemeinen CLO-Markt führen wird.

Commodities – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I -6,52 %. Im selben Zeitraum betrug die Rendite des Bloomberg Commodity Index (der Index) -7,91 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Nach einem schwierigen Jahr 2022 erzielten globale Aktien und Anleihen im Jahr 2023 eine starke Performance und trotzten damit den Erwartungen der meisten Anleger, die erwartet hatten, dass der globale Straffungszyklus die Wirtschaftstätigkeit belasten würde.
- Der Inflationsdruck ließ im Jahresverlauf nach, und die Zentralbanken gingen von einer aggressiven Rhetorik zu einer datenabhängigen Haltung über und stellten zum Jahresende die Weichen für Zinssenkungen im Jahr 2024. Während die Anleger durch ein unbeständiges, von regionalem Bankenstress und geopolitischen Spannungen geprägten Wirtschafts- und Investitionsmfeld navigierten, blieben die Unternehmensgewinne dank eines gut gestützten Verbraucher- und Arbeitsmarktes stabil.
- Der S&P 500 Index und der Bloomberg US Aggregate Bond Index stiegen beide im Laufe des Jahres an und erzielten eine Rendite von 26,29 % bzw. 5,53 %. Rohstoffe blieben im Jahr 2023 zurück, und der Index sank im Jahresverlauf um -7,91 %.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Die Positionierung im Energiesektor und eine starke Untergewichtung von Erdgas trugen am meisten zur Outperformance bei und halfen dem Portfolio, den Rückgang bei Erdgasiteln während des Berichtszeitraums zu vermeiden.
 - Agrarstoffe waren die Rohstoffe mit der besten Performance, wobei Kakao, Zucker und Kaffee die drei wichtigsten Rohstoffe darstellten. Das Portfolio verzeichnete eine Outperformance aufgrund von Gewinnen aus einer Kakao-Position von außerhalb der Benchmark.
 - Der Nutztiersektor trug aufgrund einer Übergewichtung in Lebendrindern, einer Position von außerhalb der Benchmark in Mastrindern und einer untergewichteten Position in magerem Schweinefleisch zur Outperformance des Portfolios gegenüber dem Index bei.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Energie und Industriemetalle waren die Sektoren mit der schlechtesten Wertentwicklung.
 - Die Übergewichtungen in Zink und Blei wirkten sich negativ aus.
 - Die Positionierung in Edelmetallen wurde durch eine Untergewichtung im Goldsegment und eine Position in Palladium von außerhalb der Benchmark beeinträchtigt.
 - Die Positionierung in der Landwirtschaft war leicht nachteilig. Das Portfolio profitierte zwar von einer Untergewichtung in Sojabohnen und Weizen, doch wurde dies durch die Übergewichtung in Mais und Kansas-Weizen wieder wettgemacht.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

Mit Blick auf 2024 werden mehrere wichtige Faktoren die Rohstofflandschaft prägen: Die erwarteten Zinssenkungen, eine Abschwächung des Dollars sowie die strategischen Produktionsanpassungen der OPEC+ werden die Rohstoffpreise durch die Reihe stützen. Insbesondere Energierohstoffe bieten attraktive Anlagegelegenheiten, da die aktuellen Kurse die zugrundeliegende Angebotsknappheit möglicherweise nicht vollständig widerspiegeln. Im Metallsektor sind Kupfer und Aluminium gut positioniert, um von der Beschleunigung der Energiewende zu profitieren. Ihre kritische Rolle für die grüne Technologie und Infrastruktur verspricht inmitten dieses globalen Wandels eine robuste Performance. Gold, traditionell ein sicherer Hafen, wird voraussichtlich von einem Rückgang der Realzinsen profitieren, wobei die geopolitischen Unsicherheiten zusätzliche Unterstützung bieten. Die Agrarmärkte stehen vor einem potenziellen Wendepunkt, da die drohende Gefahr eines starken El Niño die Ernteproduktion gefährden könnte, was wiederum das Schicksal der weltweiten Versorgung mit den geopolitischen Verwicklungen um den Getreidekorridor im Schwarzen Meer verknüpft. Letztlich sei noch erwähnt, dass in einem Jahr, in dem traditionelle Märkte während euphorischer Aufschwünge den Höhepunkt der „Angst, etwas zu verpassen“ (Fear of missing out, „FOMO“) erleben könnten, sich inflationsempfindliche Rohstoffe als eine umsichtige Absicherung gegen potenzielle wirtschaftliche Schlaglöcher anbieten. Wir gehen von einer Reihe komplexer Anlagegelegenheiten aus, wobei die strategische Positionierung in 2024 der Schlüssel zur Navigation durch das Marktumfeld ist.

Corporate Hybrid Bond – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse EUR I 8,14 %. Der als Benchmark dienende ICE BofA Global Hybrid Non-Financial 5 % Constrained Custom Index (Total Return, Hedged, Euro) (der Index) verbuchte im selben Zeitraum ein Plus von 9,25 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die Märkte für hybride Anleihen lieferten starke Renditen und trotzten der Volatilität, da die Fundamentaldaten intakt blieben.
- Wichtig ist, dass die Emittenten ihre Anleihen weiterhin kündigten, was hinsichtlich des idiosynkratischen Risikos in diesem Bereich der wichtigste Faktor ist. Im Jahr 2023 haben sich Unternehmen wie Ferrovial und Balder, bei denen eine Verlängerung der Kündigungsfrist für ihre wirtschaftliche Planung Sinn machte, dennoch für eine Kündigung zum ersten Kündigungstermin entschieden. Das Segment wächst weiterhin schnell, wobei sich die Diversifizierungsmöglichkeiten sowohl auf sektoraler als auch auf geografischer Ebene verbessern.
- Neuemissionen waren unserer Ansicht nach aufgrund von ESG-Bedenken weniger attraktiv.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Die Einzeltitelauswahl leistete im Verlauf des Jahres mit einer Outperformance von 121 Basispunkten (Bp) gegenüber dem Index den größten Wertbeitrag. Die Auswahl von Versorgern trug in diesem Zusammenhang relativ gesehen 91 Bp bei, während sowohl Telekommunikation (37 Bp) als auch das Gesundheitswesen (31 Bp) ebenfalls einen wichtigen Wertbeitrag leisteten.
 - Versorger, unsere größte Übergewichtung (ca. 11 %) und größte absolute Position (ca. 50 %), haben durchweg eine starke relative Performance für das Portfolio erzielt und trugen insgesamt mit 88 Bp am meisten zur Rendite bei, wobei Namen wie National Grid, EDF und Veolia Outperformance verbuchten.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Die Vermögensallokation beeinträchtigte die relative Performance mit -76 Bp am stärksten, was primär eine Folge unserer Übergewichtung von rund 6 % an Barmitteln im Portfolio war. Unsere Allokation zu Barmitteln bietet wichtige Liquidität, die es den Portfoliomanagern erlaubt, das Portfolio als Reaktion auf sich ändernde Marktbedingungen schnell zu steuern. Es handelt sich hierbei weiterhin um eine taktische Entscheidung.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Auf Sektorebene waren unsere größten Übergewichtungen im Jahr 2023 Versorger (ca. 11 %) und Telekommunikation (ca. 4 %). Diese Sektoren werden in unseren Augen weiterhin unter dem beizulegenden Zeitwert gehandelt. Wir haben Energie (ca. -13 %), den zweitgrößten Sektor im Index, weiterhin untergewichtet, da wir hier eine gewisse Disparität sehen und qualitativ hochwertigere Namen bevorzugen.
- Unsere Entscheidungen zu Anleihekäufen erfolgten auf individueller Basis nach Bewertungen, die im Zusammenhang mit einem insgesamt niedrigen Geschäftsrisiko, geringen Schwankungen der Gewinne vor Zinsen, Steuern und Abschreibungen (EBITDA) und einem vorteilhaften regulatorischen Umfeld beurteilt wurden.
- Insgesamt waren (und sind) wir bei defensiven, qualitativ hochwertigen, hochverzinsten Kupon-Unternehmensanleihen mit Eintrittsbarrieren und Unterstützung durch Interessengruppen konsistent positioniert.

Wir sind der Ansicht, dass sich die Kombination aus hohen Renditen, einer größeren Zahl an Anlagegelegenheiten durch Neuemissionen und dem Potenzial für Spread-Verengungen mit der Zeit positiv auf das Portfolio auswirken werden.

Developed Market FMP – 2027 – Bericht des Investment-Managers

Für den Berichtszeitraum von seiner Auflegung am 31. Juli 2023 bis zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 4,00 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- In dem Bemühen, die Inflation zu bekämpfen, setzten die Zentralbanken der Industrieländer ihren Zinserhöhungszyklus fort. Die Federal Reserve und die Europäische Zentralbank hoben die Leitzinsen um 100 Bp bzw. 200 Bp an.
- Die Zinsvolatilität war das ganze Jahr über hoch. Im November und Dezember, als die Inflation im Griff zu sein schien und eine Verlangsamung des Wachstums erwartet wurde, preiste der Markt zunehmend aggressive Zinssenkungen in der nahen Zukunft ein. Dies startete eine erhebliche Rally bei Staatsanleihen und Risikoanlagen.
- Die Kreditspreads verengten sich im Berichtszeitraum, was auf eine besser als erwartete Wirtschaftsleistung und eine stetige Nachfrage nach Unternehmensanleihen zurückzuführen ist. Die Kreditspreads für globale Unternehmensanleihen mit und ohne Investment Grade verengten sich um 32 Bp bzw. 122 Bp.

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

- Positivbeiträge zur absoluten Rendite:
 - Die Engagements des Portfolios in Investment-Grade- und Hochzins-Unternehmensanleihen lieferten eine breit angelegte Performance.
 - Innerhalb des Investment-Grade-Bereichs leisteten die Beteiligungen in den Bereichen Banken und Kommunikation die größten Wertbeiträge.
 - Bei den Hochzinsanleihen lagen die Engagements in Nicht-Basiskonsumgütern und Energie an der Spitze der Beitragsleister.
- Negativbeiträge zur absoluten Rendite:
 - Aus Sektorperspektive gab es keine wesentlichen Negativbeiträge.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio wurde im Juli 2023 aufgelegt.
- Das Portfolio war in verschiedenen Unternehmensbranchen, Ratingkategorien und Industrieländern investiert.
- Am Ende des Berichtszeitraums war das Portfolio zu ungefähr 80 % mit Investment Grade bewertet und zu 20 % in Positionen ohne Investment Grade investiert.

Angesichts der sich verbessernden Inflationstendenzen und dem Umstand, dass die Zinssätze der Zentralbanken wahrscheinlich ihren Höchststand erreicht haben, sind wir der Auffassung, dass das wirtschaftliche Wachstum immer wichtiger für die Renditen festverzinslicher Wertpapiere wird. Wir bevorzugen das Halten von festverzinslichen Wertpapieren mit einer Laufzeit von bis zu fünf Jahren, um die noch immer hohen Zinsen zu sichern, bevor sie wieder sinken. Wir erwarten, dass sich die Zuteilung der Kreditmärkte zugunsten von Qualität fortsetzen wird. Insgesamt glauben wir, dass 2024 eine lohnende Zeit für solche globale Anleiheinvestoren sein könnte, die sich beim Aufbau ihrer Portfolios auf Fundamentaldaten und Selektivität konzentrieren.

Emerging Market Debt – Hard Currency – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 13,87 %. Der als Benchmark dienende JPM EMBI Global Diversified Index (Total Return, USD) (der Index) verbuchte im selben Zeitraum 11,09 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Mit einer erheblichen Volatilität während des Jahres begann und endete es für Schwellenländer (EM) auf einer positiven Note, die auf der Erwartung beruhte, dass eine weiche Landung und eine ernsthafte geldpolitische Lockerung in den USA der Anlageklasse durch niedrigere Kreditkosten zugute kommen würde. Das Thema gewann im Dezember weiter an Dynamik, insbesondere nachdem die Federal Reserve eine Zinssenkung um 75 Bp für 2024 angekündigt hatte.
- Der Zusammenbruch der Silicon Valley Bank im März führte zu einigen der seit Jahrzehnten größten Bewegungen am Rentenmarkt. Ab dem Sommer führte dann die Aussicht auf für einen längeren Zeitraum höhere Zinsen zu einem großen Ausverkauf bei Anleihen, der die Renditen auf 10-jährige US-Staatsanleihen zum ersten Mal seit der globalen Finanzkrise kurzzeitig über 5 % klettern ließ.
- Die geopolitischen Ereignisse blieben ebenfalls im Fokus, insbesondere nach dem Angriff der Hamas auf Israel im Oktober, während es unterdessen keine Lösung für den Krieg in der Ukraine gab.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Die Länderallokation zeichnet sich durch die Übergewichtung von Märkten mit höheren Renditen, insbesondere El Salvador, Argentinien und Sri Lanka aus.
 - Eine Untergewichtung von niedrig verzinsten Anleihen mit Investment Grade (IG).
 - Einzeltitelauswahl über auf Euro lautende Anleihen aus Kasachstan und der Elfenbeinküste.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Eine Untergewichtung von Pakistan und der Türkei, die durch die Unterstützung des Internationalen Währungsfonds bzw. einer Hinwendung zu einer orthodoxen Politik begünstigt wurden.
 - Eine übergewichtete Allokation zu Ecuador, wo politische Herausforderungen den Druck auf die Finanzen verstärkten.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio hielt an einer Tendenz zu Hochzinstiteln (gegenüber IG-Unternehmensanleihen) fest. Wir erhöhten unsere Übergewichtung von Argentinien in Erwartung positiver politischer Anpassungen nach den Wahlen sowie ebenso in Kolumbien, El Salvador, der Elfenbeinküste und Serbien, wo wir Widerstandsfähigkeit gegenüber den strengeren globalen Finanzierungsbedingungen feststellen.
- Wir haben unsere Übergewichtung von Sambia erhöht, da wir davon ausgehen, dass der Restwert (Recovery Value) nach der Umstrukturierung höher ausfallen wird als die Marktpreise. Wir reduzierten unsere übergewichtete Allokation in Ecuador angesichts zunehmender politischer und finanzieller Risiken.
- Die Allokation zu auf Euro lautende Anleihen und Unternehmensanleihen betrug 18,8 % bzw. 13 %.

Wir gehen davon aus, dass die Anlageklasse der EM-Anleihen von einem Umfeld mit niedrigeren globalen Renditen und einem zunehmenden Wachstumsvorsprung für Schwellenländer gegenüber den Industrieländern im Jahr 2024 unterstützt werden wird. Wir sehen ein für dieses Jahr begrenztes Risiko für Ausfälle von Staatsanleihen, während das verstärkte Engagement des Internationalen Währungsfonds in verschiedenen Schwellenländern den Finanzierungsbedarf und die Reformagenda unterstützen dürfte. Die technischen Daten der Anlageklasse haben sich verbessert, da die Anleger nach einer Periode mit Rekordabflüssen hier nur noch geringfügig positioniert und die Zahl der Nettoemissionen begrenzt sind. Wir sehen Chancen für eine Verengung der Spreads bei bestimmten Emittenten und Anleihen von außerhalb der Benchmark, insbesondere im BB-Ratingsegment. Die Hauptrisiken für unsere konstruktive Sichtweise sind entweder eine unerwartete Beschleunigung der Inflationsdynamik weltweit, die deutlich mehr Zinserhöhungen erfordern würde, oder eine tiefe globale Rezession, die die EM-Risikoprämien erheblich in die Höhe treiben würde.

Emerging Market Debt – Local Currency – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 13,88 %. Der als Benchmark dienende JPMorgan GBI Emerging Markets Global Diversified Index (Total Return, Unhedged, USD) (der Index) rentierte im selben Zeitraum 12,70 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Insgesamt wurde die Marktstimmung von Entwicklungen im Zusammenhang mit Inflation und Geldpolitik geprägt. Anzeichen für Höhepunkte bei den Zinserhöhungszyklen und nachlassende Inflation in verschiedenen Schwellenländern stützten die Renditen lokaler Anleihen.
- Die durchschnittlichen Indexrenditen sanken von 6,86 % auf 6,19 %, während die Währungen der Schwellenländer (EM) gegenüber dem US-Dollar im Durchschnitt um 2,4 % aufwerteten.
- Kolumbien war das Land mit der besten Performance im Index, gefolgt von Ungarn und Brasilien, während Ägypten und die Türkei mit Negativrenditen am schlechtesten abschnitten.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Die Positionierung in der Türkei, einschließlich einer Untergewichtung der türkischen Lira, verbunden mit einer Untergewichtung der nominalen Duration gegenüber einer Übergewichtung inflationsindexierter Anleihen.
 - Die übergewichtete Duration und Devisen in Kolumbien sowie Staatsanleihen in Argentinien.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Eine Untergewichtung der Zinspositionierung in Polen und Chile.
 - Außerhalb der Benchmark liegende Beteiligungen in Ghana und Israel.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Wir haben die übergewichtete Duration im Portfolio leicht erhöht, insbesondere was asiatische Märkten wie China und Indonesien angeht, wo wir Spielraum für weitere geldpolitische Stimuli sehen.
- Wir blieben bei unserer Übergewichtung der Duration in lokalen Märkten mit hohen Realzinsen in Lateinamerika und EMEA, darunter Brasilien, Mexiko, Kolumbien und Südafrika.
- Wir behielten eine moderate Übergewichtung des Währungsrisikos bei. Angesichts der teuren Bewertungen und des schwachen Wachstums wechselten wir bei der tschechischen Krone von einer Über- zu einer Untergewichtung. Bei der türkischen Lira bauten wir eine Übergewichtung auf, da wir bei dieser Währung im Anschluss an einen sehr aggressiven Erhöhungszyklus einen Wendepunkt sehen.

Wir gehen davon aus, dass die Anlageklasse der EM-Anleihen in 2024 von einem Umfeld mit einem langsameren, aber nicht rezessiven US-Wachstum, niedrigeren globaler Renditen und einem zunehmenden Wachstumsvorsprung für Schwellenländer gegenüber den Industrieländern unterstützt werden wird. Die relativ schwache Erholung in China, die Deflation und der strukturelle Gegenwind werfen weiterhin Fragen auf. Mit Unterstützung durch eine antizyklische Geld- und Fiskalpolitik rechnen wir für das Jahr 2024 mit einem Wachstum von 4,0 % bis 4,5 %. Es wird aber dennoch erwartet, dass das BIP-Wachstum der Schwellenländer insgesamt in diesem Jahr deutlich über dem der entwickelten Märkte liegen wird. Im Großen und Ganzen gehen wir weiterhin davon aus, dass die nachlassende Inflation in den meisten Schwellenländern ihren Lauf nehmen wird, was die Wertentwicklung lokaler Anleihen unterstützt. Die Währungen der Schwellenländer dürften von der Schwäche des US-Dollar profitieren, während sie außerhalb Asiens weiterhin von einem hohen Carry unterstützt werden. Die Hauptrisiken für unsere konstruktive Sichtweise sind entweder eine unerwartete Beschleunigung der Inflationsdynamik weltweit, die zu einer restriktiveren Haltung der Zentralbanken führen würde, oder das Entstehen einer tiefen globalen Rezession, die die EM-Risikoprämien erheblich in die Höhe treiben würde.

Emerging Market Debt Blend – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 12,28 %. Der als Benchmark dienende Index, eine gewichtete Mischung aus 50 % JP Morgan GBI Emerging Markets Global Diversified Index (Total Return, nicht abgesichert, USD), 25 % JPMorgan EMBI Global Diversified Index (Total Return, USD) und 25 % JPMorgan CEMBI Diversified Index (Total Return, USD) (der Index) verbuchte im selben Zeitraum 11,29 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Insgesamt wurde die Marktstimmung von Entwicklungen im Zusammenhang mit Inflation und Geldpolitik geprägt. Anzeichen für Höhepunkte bei den Zinserhöhungszyklen und nachlassende Inflation in verschiedenen Schwellenländern stützten die Renditen lokaler Anleihen.
- Trotz der Herausforderungen, u. a. die Erwartung höherer Zinsen und schwächere Wirtschaftsdaten zu Jahresbeginn, erholten sich die globalen Märkte bis zum Jahresende aufgrund stabiler US-Zinsen und rückläufiger Inflationsindikatoren.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Eine Bottom-up-Positionierung in lokaler Währung bedingt durch eine übergewichtete Duration in Ungarn und Kolumbien. Die Long-Positionen in Devisen in Mexiko, Kolumbien und Uruguay und die Untergewichtung in der Türkei.
 - Die Bottom-up-Positionierung in Hartwährung aufgrund der Übergewichtung von Hochzins-Staatsanleihen, darunter El Salvador, Sri Lanka und Argentinien sowie aufgrund der Untergewichtung von Saudi-Arabien.
 - Die Top-down-Positionierung im Overlay aufgrund des Cash- und Devisen-Overlay war wertbeitragend.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Das Engagement bei der Zinsduration und die CDX-Position in den Overlay- und Hartwährungs-Segmenten.
 - Infolge der Positionen in China und Brasilien reduzierte sich die Bottom-up-Positionierung im Segment der Unternehmensanleihen.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Da die Märkte weiterhin von Volatilität geprägt waren, konzentrierten wir uns auf die risikobereinigte Positionierung im Overlay-Segment.
- Im Bereich der Lokalwährungen haben wir die Übergewichtung der Duration im Portfolio leicht erhöht. Wir behielten im Berichtszeitraum eine moderate Übergewichtung des Währungsrisikos bei.
- Bei den Hartwährungen haben wir unsere Tendenz zu Hochzins-Staatsanleihen gegenüber Anleihen mit Investment Grade beibehalten.

Im Jahr 2024 werden Anleihen aus Schwellenländern (EM) wahrscheinlich durch ein bescheidenes US-Wachstum, niedrigere Renditen und eine bessere Entwicklung der Schwellenländer gegenüber den Industrieländern gestärkt werden. Obwohl die Erholung Chinas und die Deflation ein Anlass zur Sorge sind, erwarten wir ein BIP-Wachstum von 4,0 % bis 4,5 %, das durch eine proaktive Geld- und Fiskalpolitik unterstützt wird. Die Schwellenländer sollten die Industrieländer beim BIP-Wachstum überholen. Eine Desinflation könnte EM-Anleihen in Hartwährung begünstigen, während ein schwacher US-Dollar den EM-Währungen Auftrieb geben könnte, insbesondere im Fall eines hohen Carry außerhalb Asiens. Allerdings gehören zu den Risiken mögliche globale Inflationsschübe oder eine schwere Rezession, die die EM-Risikoprämien in die Höhe treiben.

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 8,32 %. Im selben Zeitraum verbuchte die zusammengesetzte Benchmark – ein Drittel der JPMorgan GBI Emerging Markets Global Diversified Investment Grade 15% Cap Index (Total Return, nicht abgesichert, USD) und zwei Drittel der JPMorgan EMBI Global Diversified Investment Grade Index (Total Return, USD) (der Index) – ein Plus von 9,28 %. (Die Performance für alle Anteilsklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Insgesamt wurde die Marktstimmung von Entwicklungen im Zusammenhang mit Inflation und Geldpolitik geprägt. Anzeichen für Höhepunkte bei den Zinserhöhungszyklen und nachlassende Inflation in verschiedenen Schwellenländern stützten die Renditen lokaler Anleihen.
- Trotz der Herausforderungen, u. a. die Erwartung höherer Zinsen und schwächere Wirtschaftsdaten zu Jahresbeginn, erholten sich die globalen Märkte bis zum Jahresende aufgrund stabiler US-Zinsen und rückläufiger Inflationsindikatoren.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Eine Bottom-up-Positionierung in lokaler Währung bedingt durch eine übergewichtete Duration in Ungarn und Kolumbien. Ebenso positiv waren die Long-Positionen im mexikanischen Peso, kolumbianischen Peso und uruguayischen Peso.
 - Die Bottom-up-Positionierung in Hartwährungen war aufgrund der Übergewichtung in Rumänien, des Engagements außerhalb der Benchmark in Südkorea und der Nullgewichtung von Saudi-Arabien ebenfalls additiv.
 - Die Top-down-Positionierung im Overlay aufgrund der Barmittelposition war wertbeitragend.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Das Engagement bei der Zinsduration im Overlay und im Hartwährungs-Segment sorgte für Wertabzüge.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Da die Märkte weiterhin von Volatilität geprägt waren, konzentrierten wir uns auf die risikobereinigte Positionierung im Overlay-Segment.
- Bei den Lokalwährungen haben wir die Übergewichtung der Duration im Portfolio leicht erhöht. Wir behielten im Berichtszeitraum eine moderate Übergewichtung des Währungsrisikos bei.
- Im Bereich der Hartwährungen stockten wir das Engagement in Staatsanleihen mit starken Fundamentaldaten auf. Außerdem haben wir uns an den laufenden Emissionen von Investment-Grade-Titeln, die zu attraktiven Preisen angeboten wurden, beteiligt.

Im Jahr 2024 werden Anleihen aus Schwellenländern (EM) wahrscheinlich durch ein bescheidenes US-Wachstum, niedrigere Renditen und eine bessere Entwicklung der Schwellenländer gegenüber den Industrieländern gestärkt werden. Obwohl die Erholung Chinas und die Deflation ein Anlass zur Sorge sind, erwarten wir ein BIP-Wachstum von 4,0 % bis 4,5 %, das durch eine proaktive Geld- und Fiskalpolitik unterstützt wird. Die Schwellenländer sollten die Industrieländer beim BIP-Wachstum überholen. Eine Desinflation könnte EM-Anleihen in Hartwährung begünstigen, während ein schwacher US-Dollar den EM-Währungen Auftrieb geben könnte, insbesondere im Fall eines hohen Carry außerhalb Asiens. Allerdings gehören zu den Risiken mögliche globale Inflationsschübe oder eine schwere Rezession, die die EM-Risikoprämien in die Höhe treiben.

Emerging Markets Equity – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtertragsrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD 17,69 %. Der als Benchmark dienende MSCI Emerging Markets Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) verzeichnete im selben Zeitraum ein Plus von 9,83 %. (Die Performance für alle Anteilsklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtertragsrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Aktienwerte aus Schwellenländern (EM) legten im Jahr 2023 zu, insbesondere im vierten Quartal. Die Rally zum Jahresende war auf den Optimismus zurückzuführen, dass die US-Notenbank im Jahr 2024 mit Zinssenkungen beginnen könnte. EM-Aktien schnitten im Jahresverlauf allerdings aufgrund der Schwäche in China schlechter ab als internationale Aktien der Industrieländer (MSCI World) und US-Aktien (S&P 500).
- Innerhalb des Index erzielten IT, Energie und Finanzwerte eine überdurchschnittliche Wertentwicklung, während die Indexkomponenten mit einem erheblichen Engagement in China – Immobilien, Nicht-Basiskonsumgüter (einschließlich chinesischer Internetunternehmen) und Gesundheitswesen – an Wert einbüßten.
- Auf Länderbasis legten Ungarn und Griechenland mit Zuwächsen um die +50 % am meisten zu. China und Thailand verzeichneten die größten Verluste.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Die Einzeltitelauswahl und eine Übergewichtung des starken IT-Sektors sowie das Gesundheitswesen
 - Nach Ländern betrachtet, leisteten Aktien aus Taiwan, Saudi-Arabien und Indien die größten Wertbeiträge.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Das Portfolio blieb hinter dem Index zurück, was vor allem auf die Einzeltitelauswahl unter Nicht-Basiskonsumgütern und Finanzwerten zurückzuführen ist.
 - Nach Ländern ergaben sich die größten Wertabzüge durch Beteiligungen in China, gefolgt von denen in Mexiko und Korea.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Infolge der Bottom-up-Einzeltitelauswahl beschloss das Portfolio den Berichtszeitraum mit Übergewichtungen in den Sektoren IT, Basiskonsumgüter und Gesundheitswesen und Untergewichtungen in den Sektoren Nicht-Basiskonsumgüter, Werkstoffe und Versorgung.
- Zu den größten Länderübergewichtungen zum Jahresende gehörten Allokationen von außerhalb der Benchmark in in den USA und im Vereinigten Königreich notierte Titel, eine Nische in wichtigen Schwellenländern sowie Indien. Die Aufstockungen in diesen Regionen wurden durch eine weitere Reduzierung der chinesischen Positionen finanziert, die zusammen mit Südafrika und Korea am meisten untergewichtet waren.

Aus makroökonomischer Sicht könnten im Jahr 2024 die Präsidentschaftswahlen in den USA und die vielen Wahlen in Schwellenländern weiterhin für Schlagzeilen sorgen und auf kurze Sicht Einfluss auf die Entwicklung der Aktienrenditen in den Schwellenländern haben. Das Team ist jedoch der Ansicht, dass der Rückenwind durch eine niedrigere Inflation und sinkende Zinssätze zusammen mit einem potenziellen Aufschwung im Halbleiterzyklus (der sich auf IT, unsere größte Übergewichtung, auswirkt) für die Anlageklasse und das Portfolio im Jahr 2024 Gutes verheißen sollte.

Aus Bottom-up-Perspektive besitzen wir eine Reihe an Namen mit hoher Überzeugungskraft, die in Bereichen agieren, die in unseren Augen unabhängig von den globalen BIP-Raten ein nachhaltiges Wachstumspotenzial bieten. Wir denken daher, dass das Portfolio für das kommende Jahr gut aufgestellt ist.

Emerging Markets Select Equity – Berichts des Investment-Managers

Für den Zeitraum vom 1. Januar 2023 bis zur Schließung des Portfolios am 7. September 2023 betrug die Gesamtertragsrendite für die Thesaurierende Klasse USD 13,83 %. Der als Benchmark dienende MSCI Emerging Markets Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) verzeichnete im selben Zeitraum ein Plus von 5,15 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtertragsrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Aktien aus Schwellenländern (EM) legten in diesem Berichtszeitraum zu. Der Optimismus, dass die US-Notenbank im Jahr 2024 mit einer Zinssenkung beginnen könnte, wurde durch die Schwäche in China konterkariert, so dass EM-Aktien sowohl hinter den Aktien internationaler Industrieländer (MSCI World) als auch hinter denen der USA (S&P 500) hinterher hinkten.
- Innerhalb des Index verbuchten die Energie-, IT- und Industriekomponenten bis Anfang September eine Outperformance, während Versorger, Gesundheitswesen und Immobilien nachgaben.
- Nach Ländern betrachtet, legten Griechenland und Ungarn in diesem Berichtszeitraum am meisten zu. Kolumbien und Südafrika verzeichneten die größten Verluste.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Die Einzeltitelauswahl und die Übergewichtung der starken Sektoren Energie und IT war der Wertsteigerung förderlich.
 - Nach Ländern betrachtet, leisteten Aktien aus Taiwan, Südafrika und Saudi-Arabien die größten Wertbeiträge.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Das Portfolio blieb hinter dem Index zurück, was vor allem auf die Einzeltitelauswahl unter Nicht-Basiskonsumgütern und Finanzwerten zurückzuführen war.
 - Auf Länderbasis schädeten Beteiligungen in China am meisten, gefolgt von unserem nicht im Index enthaltenen Engagement bei EM-Titeln mit Sitz in Großbritannien und koreanischen Aktien.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Als Ergebnis einer Bottom-up-Einzeltitelauswahl lagen die größten Übergewichtungen des Portfolios zum Ende des Berichtszeitraums in den Bereichen IT, Basiskonsumgüter und Industriewerte. Zu den Untergewichtungen gehörten Werkstoffe, Kommunikationsdienste und Versorger.
- Zu den größten Länderübergewichtungen gehörten Allokationen von außerhalb der Benchmark zu in den USA und im Vereinigten Königreich notierten Titeln mit Nischeninteressen in wichtigen Schwellenländern sowie Hongkong. China, Malaysia und Saudi-Arabien waren die wichtigsten Untergewichtungen des Portfolios.

Das Portfolio wurde am 7. September 2023 geschlossen. Wir danken Ihnen für die Gelegenheit, Sie bei der Erfüllung Ihrer finanziellen Bedürfnisse zu unterstützen.

Euro Bond – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamterrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse EUR I 9,94 %. Der Bloomberg Euro Aggregate Index (Total Return, Hedged, EUR) (der Index) rentierte im selben Zeitraum 7,19 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamterrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividenden erträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die ersten drei Quartale des Jahres 2023 wurden durch die aggressive Geldpolitik der Europäischen Zentralbank (EZB) beeinflusst, die ihren Leitzins um 200 Basispunkte (Bp) anheb. Trotz der Spannungen im Bankensektor lag die Priorität der EZB darauf, die monetären Bedingungen zu verschärfen, um die Auswirkungen des Inflationsanstiegs zu bekämpfen – sie lag über 5 % - und auf die Lohnsteigerungen zu reagieren.
- Im letzten Quartal 2023 hörte die EZB mit ihren Leitzinserhöhungen auf, da der EZB-Rat der Ansicht war, dass sie ein Niveau erreicht hatten, das, wenn es „für eine ausreichend lange Zeit beibehalten wird, einen wesentlichen Beitrag zur rechtzeitigen Rückkehr der Inflation zur Zielmarke leisten wird“.
- Die Konjunktur in der Eurozone blieb über das ganze Jahr hinweg schwach, mit einer leichten Rezession im Industriesektor in Nordeuropa und einem robusten Wachstum in Südeuropa dank der Unterstützung durch die öffentlichen Ausgaben. In den letzten beiden Monaten des Jahres gab es Anzeichen, dass das Wachstum die Talsohle erreicht hatte, doch führte dies nicht zu einem Anstieg der Unternehmensausfälle, was für die Kreditmärkte positiv ist.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Der Hauptgrund für die Outperformance des Portfolios gegenüber dem Index war die Emittentenauswahl, wobei die Rally zum Jahresende besonders stark war.
 - Die Verwaltung unseres Zinsengagements erwirtschaftete zusätzliche Erträge, hauptsächlich durch die Renditekurvenpositionierung.
 - Unsere Sektorrotation war im Jahr 2023 erfolgreich. Die Spannungen im Bankensystem im ersten Quartal veranlassten uns, unsere Gewichtung im Finanzsektor zu erhöhen, während die niedrigeren Kosten im Energiesektor zu einer Aufstockung bei Investitionsgütern in der zweiten Jahreshälfte führten.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Derivate beeinträchtigten die Wertentwicklung bedingt durch den Kauf von Kreditabsicherungen.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Zu Beginn des Jahres 2023 war unsere Duration untergewichtet, doch wurde sie Anfang März im Zuge der Spannungen im Bankensystem wieder auf neutral gesetzt. Im zweiten Quartal hatten wir durch die hohe Marktvolatilität die Gelegenheit, unser Durationsengagement schrittweise auf bis zu 1 Jahr zu erhöhen, wobei wir in erster Linie Anleihen mit einer 5-jährigen Laufzeit kauften. Bis zum Jahresende haben wir angesichts der sinkenden Zinsen die Gewinne realisiert und unsere Durationsübergewichtung auf eine Untergewichtung umgestellt.
- Außerdem haben wir unsere Länderallokation aktiv gesteuert. Im ersten Quartal schlossen wir unser untergewichtetes Engagement bei italienischen Staatsanleihen, um wieder auf eine neutrale Position zu kommen. Als wir die Duration wieder erhöhten, geschah dies mithilfe deutscher Bundesanleihen und mit Swap-Spread-Produkten auf Kosten von Semi-Kernländern wie Frankreich.
- Über das ganze Jahr hinweg haben wir ein übergewichtetes Kreditengagement gesteuert, um von der Marktvolatilität und den sich auf dem Primärmarkt bietenden Anlagegelegenheiten zu profitieren. Wir hatten hauptsächlich BBB-Emittenten und Hochzinsanleihen übergewichtet, die am empfindlichsten auf die Marktentwicklung reagierten.

Wir denken, dass der Fokus der Märkte im neuen Jahr darauf liegen wird, wie schnell und wie niedrig die Inflation in Abhängigkeit von den Ergebnissen der Lohnverhandlungen fallen wird. Wir glauben, dass die EZB erst dann ihre restriktive Politik aufgeben wird, wenn die Inflation nachhaltig auf ihr Ziel von 2 % sinkt. Dies verstärkt die Risiken durch eine zu restriktive Geldpolitik, die zu einer harten Rezession führen könnte, und Dies sollte den Anstieg der realen Renditen begrenzen und die Kurse am Rentenmarkt stützen.

Euro Bond Absolute Return – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamterrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse EUR I 8,17 %. Der ICE BofA 0-1 Year AAA Euro Government Index (Total Return, EUR) (der Index) verzeichnete im selben Zeitraum 2,46 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamterrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die ersten drei Quartale des Jahres 2023 wurden durch die aggressive Geldpolitik der Europäischen Zentralbank (EZB) beeinflusst, die ihre Leitzinsen um 200 Basispunkte (Bp) anhub. Trotz der Spannungen im Bankensektor lag die Priorität der EZB darauf, die monetären Bedingungen zu verschärfen, um die Auswirkungen des Inflationsanstiegs, der über 5 % lag, auf die Löhne zu bekämpfen.
- Im letzten Quartal 2023 hörte die EZB mit ihren Leitzinserhöhungen auf, da der EZB-Rat der Ansicht war, dass sie ein Niveau erreicht hatten, das, wenn es „für eine ausreichend lange Zeit beibehalten wird, einen wesentlichen Beitrag zur rechtzeitigen Rückkehr der Inflation zur Zielmarke leisten wird“.
- Die Konjunktur in der Eurozone blieb über das ganze Jahr hinweg schwach, mit einer leichten Rezession im Industriesektor in Nordeuropa und einem robusten Wachstum in Südeuropa dank der Unterstützung durch die öffentlichen Ausgaben. In den letzten beiden Monaten des Jahres gab es Anzeichen, dass das Wachstum die Talsohle erreicht hatte, doch führte dies nicht zu einem Anstieg der Unternehmensausfälle, was für die Kreditmärkte positiv ist.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Der Hauptgrund war die Emittentenauswahl, wobei die Rally zum Jahresende besonders stark war.
 - Die Verwaltung unseres Zinsengagements erwirtschaftete zusätzliche Erträge, hauptsächlich durch die Renditekurvenpositionierung.
 - Long-Swap-Spreads über Zinsswaps und Proxy-Swaps waren gegenüber Staatsanleihen aus Kernländern erfolgreich.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Die Absicherung von hochverzinslichen Credit Default Swaps mit iTraxx Crossover beeinträchtigte die Performance.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Die Duration war zu Anfang 2023 gering und wurde gegen Anfang März im Rahmen der Spannungen im Bankensystem wieder auf 2-2,5 Jahre erhöht. Im zweiten Quartal hatten wir durch die hohe Marktvolatilität die Gelegenheit, unser Durationsengagement auf 4 Jahre zu erhöhen, wobei wir in erster Linie Anleihen mit einer 5-jährigen Laufzeit gekauft haben. Zum Jahresende nahmen wir während der Rally am Euro-Markt schrittweise die Gewinne mit und steuerten die Portfolioduration wieder in Richtung auf 2,5 Jahre.
- Außerdem haben wir unsere Länderallokation aktiv gesteuert. Im ersten Quartal, als sich der Spread gegenüber deutschen Bundesanleihen der Marke von 200 Bp näherte, schlossen wir unsere absolute Short-Duration in Italien, während wir bei spanischen und portugiesischen Staatsanleihen investiert blieben. Als wir die Duration zurückbrachten, geschah dies über Swap-Kontrakte im kurz- bis mittelfristigen Kurvenbereich und Proxy-Swaps (Agenturen, gedeckte Anleihen) versus Semi-Kernländer wie Frankreich.
- Über das ganze Jahr hinweg haben wir ein umfassendes Kreditengagement gesteuert, um von der Marktvolatilität und den sich auf dem Primärmarkt bietenden Anlagegelegenheiten zu profitieren. Wir waren hauptsächlich bei Emittenten mit BBB-Rating und in Hochzinsanleihen engagiert, die am empfindlichsten auf die Marktentwicklung reagierten.

Mit Blick auf die Zukunft glauben wir, dass die Märkte ihr Augenmerk auf die Entwicklung der Kerninflation konzentrieren werden, abhängig vom Ergebnis der Lohnverhandlungen. Wir glauben, dass die EZB erst dann ihre restriktive Politik aufgeben wird, wenn die Inflation nachhaltig auf ihr Ziel von 2 % sinkt. Dies verstärkt die Risiken einer zu restriktiven Geldpolitik, die zu einer harten Rezession führen könnte. Dies sollte den Anstieg der realen Renditen begrenzen und die Kurse am Rentenmarkt stützen.

European High Yield Bond – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse EUR I 13,53 %. Im selben Zeitraum verzeichnete der als Benchmark dienende ICE BofA European Currency Non-Financial High Yield 3% Constrained Index (Total Return, EUR) (der Index), 12,11 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Der europäische Hochzinsmarkt verzeichnete trotz einiger Perioden mit Volatilität im Laufe des Jahres starke Erträge. Die Gesamrendite des Index von 12,11 % war die höchste seit 2012. Trotz einer anfänglichen Ausweitung der Spreads im Oktober trugen die deutliche Rally zum Jahresende bei Risikoanlagen und die Spread-Verengung um rund 50 Basispunkte im letzten Quartal zusammen mit dem Carry zu den starken Renditen bei.
- Die aggregierten Fundamentaldaten von Hochzinsemitenten in Bezug auf das Wachstum des Gewinns vor Zinsen, Steuern und Abschreibungen (EBITDA), der freie Cashflow, die Zinsdeckung und der Verschuldungsgrad, hielten sich in einem recht günstigen Bereich, und die Ertragsaison fiel im Großen und Ganzen besser aus als befürchtet. Die Aussichten in Bezug auf Zahlungsausfälle blieben ebenfalls relativ günstig.
- Zwar stieg die Ausfallquote von ihren Tiefstständen im Jahr 2022, doch erwarten wir, dass die Ausfallquoten in einem Bereich knapp unter dem langfristigen Durchschnitt bleiben werden. Dieser Ausblick stützt sich auf unsere Bottom-up-Beurteilung von Emittenten und wird getragen von dem qualitativ höherwertigen Ratingsmix im europäischen Hochzinssegment (63 % der Emittenten mit Kreditratings von BB), von weniger aggressiven Neuemissionen, weniger kurzfristigen Fälligkeiten sowie einem Energiesektor, der deutlich solider ist als in den letzten Zyklen.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Aus sektoraler Sicht leisteten die Positionierungen in den Bereichen Auto, Verpackungen und Finanzunternehmen den größten Wertbeitrag.
 - Aus der Perspektive der Ratings trugen die Positionierungen bei Emittenten mit einem Rating von BB, B und CCC und darunter am meisten zur Wertentwicklung bei.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Aus Sektorspektive waren die Positionierungen in den Bereichen Freizeit, Energie sowie Nahrungsmittel & Getränke am nachteiligsten für die Performance.
 - Aus der Perspektive der Ratings zeichneten die Positionierungen bei Emittenten mit einem Rating von BBB und höher für die meisten Wertabzüge verantwortlich.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

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

Wir sind der Meinung, dass die Bewertungen europäischer Hochzinsanleihen eine mehr als angemessene Entschädigung für die mehr oder weniger durchschnittlichen Ausfallerwartungen darstellen, die Anleihen weiterhin dauerhafte Erträge bieten und im Vergleich zu anderen festverzinslichen Alternativen attraktiv sind. Da die Kreditstreuung zugenommen hat, konzentrieren sich unsere Analysten auf die spezifischen Fundamentaldaten individueller Emittenten und bewerten die Basis- und Abwärtsszenarien im Falle einer weichen Landung oder Rezession. Darüber hinaus gehen wir davon aus, dass die Streuung zwischen Branchen, Ratingkategorien, Emittenten und Regionen weiterhin hoch sein wird, was Anlagegelegenheiten für höhere Renditen durch die Einzeltitelauswahl bietet. In diesem Zusammenhang wird sich eine gründliche Bottom-up-Kreditanalyse in Verbindung mit einem engen Kontakt zu den Managementteams, den Sponsoren und Gegenparteien an der Börse als entscheidend erweisen, damit wir unser Portfolio optimieren können, um aus den gebotenen Chancen Kapital zu schlagen.

European Sustainable Equity – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse EUR I 18,99 %. Der als Benchmark dienende MSCI Europe Index (Total Return, abzüglich Steuern, EUR) (der Index) verzeichnete im selben Zeitraum 15,83 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die Aktienmärkte begannen das Jahr 2023 mit einer kräftigen Erholung, da sich die Inflation abschwächte, doch gab es auch Gegenwind durch die Zentralbanken, die die Zinssätze im Laufe des Jahres weiter anhoben.
- Gegen Mitte des Jahres führten Rezessionsängste und Spannungen im Finanzsektor, einschließlich des Zusammenbruchs namhafter US-Regionalbanken zu Beginn des Jahres, zu einer erhöhten Volatilität und Marktschwäche.
- Die Märkte beendeten das Jahr jedoch mit einer robusten Performance, unterstützt durch den Optimismus hinsichtlich einer gelockerten Geldpolitik und sinkender langfristiger Zinsen, da der Inflationsdruck nachließ.
- Die US-Wirtschaft zeigte starkes Wachstum, im Gegensatz zu Europa und Japan, wo sich die Konjunktur abschwächte.

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

- Positivbeiträge zur relativen Gesamrendite:
 - Eine übergewichtete Sektorallokation gegenüber dem Index in IT und von Industrierwerten trug am meisten zur Performance bei.
 - Die Einzeltitelauswahl unter Finanzwerten und im Gesundheitswesen.
 - Eine Untergewichtung im Energiesektor, weil die Nachfrage nach Öl und Gas vor dem Hintergrund eines sich abschwächenden globalen Wirtschaftswachstums unter Druck geriet.
 - Auf Aktienebene trugen die Beteiligungen an in 3i Group, Partners Group, London Stock Exchange Group (Finanzwerte), VAT Group und Schneider (Industriewerte) am meisten zur Performance bei.
- Negativbeiträge zur relativen Gesamrendite:
 - Die Einzeltitelauswahl im Bereich der Nicht-Basiskonsumgüter aufgrund des Gegenwinds durch nachlassende Konsumausgaben.
 - Aktien von Alfen (Industriewerte), SolarEdge Technologies (IT), Bakkafrost (Basiskonsumgüter) und Sartorius Stedim Biotech (Gesundheitswesen) waren für die größten Wertabzüge verantwortlich.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Wir haben das vertikal integrierte Unternehmen Essilor Luxottica (Augenpflege) in das Portfolio aufgenommen. Das Unternehmen profitiert von strukturellen Trends wie z. B. der zunehmenden Kurzsichtigkeit und einer alternden Bevölkerung.
- Des Weiteren haben wir Reply aufgenommen, ein IT-Beratungs- und digitales Dienstleistungsunternehmen mit einem einzigartigen dezentralisierten Netzwerk von auf Nischen spezialisierten Unternehmen, die ihren Kunden bei der Verbesserung in Bereichen wie Ressourceneffizienz und Cybersicherheit helfen.
- Unsere Position in Cellnex wurde aufgrund des begrenzten Potenzials für Tarifsteigerungen in einem Hochinflationsumfeld veräußert. Wir denken, dass das Unternehmen bei der Verwaltung seiner Kostenbasis und seiner fremdfinanzierten Bilanz mit erheblichen Herausforderungen konfrontiert ist.
- Die Position im Tierarzneimittelunternehmen Dechra wurde nach einem Private-Equity-Angebot verkauft.

Das wirtschaftliche Umfeld stellt weiterhin eine Herausforderung dar, mit Unsicherheiten in Bezug auf Inflation, die Zentralbankpolitik, Wahlergebnisse und geopolitische Entwicklungen. In diesem Zusammenhang gehen wir weiterhin davon aus, dass unser Ansatz der richtige ist: die Verwaltung eines fokussierten Portfolios von Qualitätsunternehmen mit einer dauerhaften Wettbewerbsposition, einem starken Management wesentlicher ESG-Aspekte und der Fähigkeit, sich an Veränderungen anzupassen. Wir glauben, dass solche Unternehmen, die wir als „Transition Winners“ bezeichnen, gut gerüstet sind, um langfristig zu wachsen. Dies gilt umso mehr in unsicheren Zeiten, da der Fokus dieser Unternehmen auf Nachhaltigkeit ihren Wettbewerbsvorteil weiter stärkt.

Event Driven – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtertragsrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 4,25 %. Der S&P 500 Index* (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) rentierte im selben Zeitraum 25,67 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtertragsrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die erste Jahreshälfte (sogar ab November 2022) war eine der seit Jahrzehnten schwierigsten Perioden für Risikoarbitrage, die durch zahlreiche gescheiterte Transaktionen und rechtliche Herausforderungen gekennzeichnet war. Wir haben diese Periode erfolgreich durchlaufen und konnten dank unseres tiefgreifenden, fundamentalen Researchprozesses zu Risiken und Chancen allen gescheiterten Transaktionen aus dem Weg gehen. Wir waren in der Lage, aus den weiteren Spreads bei solchen Anlagegelegenheiten Kapital zu schlagen, bei denen die Regulierungsbehörden letztlich erfolglos versucht hatten, Transaktionen zu blockieren.
- Nach einer Reihe von gerichtlichen Niederlagen verfolgten die Aufsichtsbehörden einen rationaleren Ansatz bei der Bewertung von Transaktionen. Dies bedeutet nicht, dass die Aufsichtsbehörden kartellrechtliche Vorschriften nicht aggressiv verfolgen werden oder dass das Pendel vollständig zurückgeschwungen ist, es deutet jedoch daraufhin, dass bestimmte Situationen investitionsfähiger werden könnten. Darüber hinaus wird diese ein wenig entspanntere Haltung wahrscheinlich mehr Transaktionen ermutigen, da die Verwaltungsräte das derzeitige regulatorische Umfeld verarbeiten.
- Auf Seite der Strategie Market Neutral Catalyst (marktneutraler Katalysator) ergaben sich gute Anlagegelegenheiten, da eine größere Zahl an Unternehmen verschiedene Formen von Kapitalmaßnahmen in Erwägung zogen, um den Shareholder Value in einem unsicheren makroökonomischen Umfeld zu steigern. Wir müssen allerdings geduldig bleiben, um diese Wertschöpfung zu realisieren, da es Zeiten gibt, in denen eine durch Beta angetriebene Rally (z. B. Januar, Juni, November und Dezember) mit einem stark abgesicherten Beta und neutralem Stillfaktor kurzfristig für Gegenwind sorgen kann.

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

- Positivbeiträge zur absoluten Rendite:
 - Sowohl die Strategie Risiko Arbitrage als auch die Strategie Market Neutral Catalyst leisteten positive Wertbeiträge.
 - Die besten Performancebeiträge kamen von Uber Technologies (Catalyst), Meta Platforms (Catalyst), US Steel (Risiko), Activision Blizzard (Risiko) und Broadcom (Catalyst).
- Negativbeiträge zur absoluten Rendite:
 - Die fünf Titel verantwortlich für die größten Negativbeiträge waren Willscot Mobile Mini (Catalyst), NextEra Energy (Catalyst), Dollar Tree (Catalyst), Bristol-Meyers Squibb (Catalyst) und PayPal (Catalyst).

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das investierbare Universum für die Risiko-Arbitrage-Strategie war im Jahr 2023 kleiner. Einfache Transaktionen mit begrenzter aufsichtsrechtlicher Komplexität wurden zu eng bepreist und boten kein attraktives Risiko-/Ertragsprofil, da diese „sicheren“ Transaktionen im Fokus von speziellen Risiko-Arbitrage-Strategien standen. Das Universum der Transaktionen, in die wir investiert haben, lieferte trotz eines nur geringeren Engagements sehr attraktive absolute und risikobereinigte Renditen für das Portfolio.
- In Bezug auf die Strategie Market Neutral Catalyst fanden wir eine Reihe von idiosynkratischen Anlagegelegenheiten für den Kapitaleinsatz. Wir tendierten zu einem höheren Prozentsatz an weichen Titeln gegenüber katalytischen Titeln, da wir sie unserer Meinung nach effizienter absichern können. Außerdem haben wir die durchschnittliche Positionsgröße etwas kleiner gehalten, während sie an Überzeugungskraft gewinnen und der Zeitraum bis zum tatsächlichen Ereignis kürzer wird.

Wir erwarten, dass die Risikovolumina Anfang 2024 deutlich ansteigen werden, da die Unternehmen nach Jahren mit Marktvolatilität, mit Inflation und der Unterbrechung der Lieferkette ihr Wachstum fortsetzen und der Druck auf die Kapitalkosten nachlässt. Die Welt ist angesichts der geopolitischen Situation, der makroökonomischen Entwicklungen und eines sehr unsicheren Wahljahres in den USA nach wie vor recht instabil. Wir finden immer noch idiosynkratische Ideen mit spezifischen Katalysatoren, von denen wir annehmen, dass sie Wert schaffen oder zerstören können, und sichern Situationen mit dem Ziel ab, das Kapital in allen Szenarien zu schützen.

* Das Portfolio wird aktiv verwaltet und beabsichtigt nicht, den Index nachzubilden. Er wird hier lediglich zu Zwecken des Vergleichs der Wertentwicklung herangezogen.

Global Bond – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD 16,54 %. Der als Benchmark dienende Bloomberg Global Aggregate Index (Total Return, Unhedged, USD) (der Index) verbuchte im selben Zeitraum 5,72 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- In dem Bemühen, die Inflation zu bekämpfen, setzten die Zentralbanken der Industrieländer ihren Zinserhöhungszyklus fort. Die Federal Reserve und die Europäische Zentralbank hoben die Leitzinsen um 100 Bp bzw. 200 Bp an.
- Die Zinsvolatilität war das ganze Jahr über hoch. Im November und Dezember, als die Inflation im Griff zu sein schien und eine Verlangsamung des Wachstums erwartet wurde, preiste der Markt zunehmend aggressive Zinssenkungen in der nahen Zukunft ein. Dies trug zu einer erheblichen Rally bei Staatsanleihen und Aktien bei.
- Die Kreditspreads verengten sich im Berichtszeitraum, was auf eine besser als erwartete Wirtschaftsleistung und eine stetige Nachfrage nach Unternehmensanleihen zurückzuführen ist. Die Kreditspreads für globale Unternehmensanleihen mit und ohne Investment Grade verengten sich um 32 Bp bzw. 122 Bp.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Die Übergewichtung von hypothekarisch besicherten Wertpapieren (MBS) und der Allokation zu Kreditrisikotransfers.
 - Das übergewichtete Engagement und die Einzeltitelauswahl bei globalen Unternehmensanleihen mit Investment Grade.
 - Die Untergewichtung britischer Zinsen, eine Übergewichtung der Zinssätze europäischer Kernländer und die US-Renditekurvenpositionierung.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Die Untergewichtung von Zinsen in China und Japan.
 - Das aktive Devisen-Overlay des Portfolios.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Wir erhöhten das Engagement bei quasistaatlichen MBS und europäischen Investment-Grade-Unternehmensanleihen und reduzierten die Gewichtung von US-amerikanischen Unternehmensanleihen mit Investment Grade ebenso wie die von globalen Staatsanleihen.
- Wir haben die Duration des Portfolios um ca. ein dreiviertel Jahr erhöht, bleiben aber auf Kernebene bei der Duration untergewichtet.

Angesichts der sich verbessernden Inflationstendenzen und dem Umstand, dass die Zinssätze der Zentralbanken wahrscheinlich ihren Höchststand erreicht haben, sind wir der Auffassung, dass das wirtschaftliche Wachstum immer wichtiger für die Renditen festverzinslicher Wertpapiere wird. Wir bevorzugen das Halten von festverzinslichen Wertpapieren mit einer Laufzeit von bis zu fünf Jahren, um die noch immer hohen Zinsen zu sichern, bevor sie wieder sinken. Wir erwarten, dass sich die Zerteilung der Kreditmärkte zugunsten von Qualität fortsetzen könnte. Insgesamt glauben wir, dass 2024 eine lohnende Zeit für solche globale Anleiheinvestoren sein könnte, die sich beim Aufbau ihrer Portfolios auf Fundamentaldaten und Selektivität konzentrieren.

Global Diversified Income FMP – 2024 – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD 15,84 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- In dem Bemühen, die Inflation zu bekämpfen, setzten die Zentralbanken der Industrieländer ihren Zinserhöhungszyklus fort. Die Federal Reserve und die Europäische Zentralbank hoben die Leitzinsen um 100 Bp bzw. 200 Bp an.
- Die Zinsvolatilität war das ganze Jahr über hoch. Im November und Dezember, als die Inflation im Griff zu sein schien und eine Verlangsamung des Wachstums erwartet wurde, preiste der Markt zunehmend aggressive Zinssenkungen in der nahen Zukunft ein. Dies startete eine erhebliche Rally bei Staatsanleihen und Risikoanlagen.
- Die Kreditspreads verengten sich im Berichtszeitraum, was auf eine besser als erwartete Wirtschaftsleistung und eine stetige Nachfrage nach Unternehmensanleihen zurückzuführen ist. Die Kreditspreads für US-amerikanische Unternehmensanleihen mit und ohne Investment Grade (IG) verengten sich um 32 Bp bzw. 122 Bp.

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

- Positivbeiträge zur absoluten Rendite:
 - Das Engagement in Unternehmensanleihen mit Investment Grade aus Industrieländern.
 - Das Engagement in Hochzinsanleihen aus Industrieländern.
 - Das Engagement in Unternehmensanleihen aus Schwellenmärkten.
- Negativbeiträge zur absoluten Rendite:
 - Aus Sektorperspektive gab es keine wesentlichen Negativbeiträge.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio war in verschiedenen Kreditsektoren sowie über Ratingkategorien und Regionen investiert.
- Am Ende des Berichtszeitraums stellten Investment-Grade-Unternehmensanleihen die größte Sektorallokation dar, gefolgt von EM-Unternehmensanleihen und Hochzinsanleihen.

Angesichts der sich verbessernden Inflationstendenzen und dem Umstand, dass die Zinssätze der Zentralbanken wahrscheinlich ihren Höchststand erreicht haben, sind wir der Auffassung, dass das wirtschaftliche Wachstum immer wichtiger für die Renditen festverzinslicher Wertpapiere wird. Wir bevorzugen das Halten von festverzinslichen Wertpapieren mit einer Laufzeit von bis zu fünf Jahren, um die noch immer hohen Zinsen zu sichern, bevor sie wieder sinken. Wir erwarten, dass sich die Zerteilung der Kreditmärkte zugunsten von Qualität fortsetzen wird. Insgesamt glauben wir, dass 2024 eine lohnende Zeit für solche globale Anleiheinvestoren sein könnte, die sich beim Aufbau ihrer Portfolios auf Fundamentaldaten und Selektivität konzentrieren.

Global Equity Megatrends – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamterrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD 1 22,91 %. Der als Benchmark dienende MSCI World Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) verzeichnete im selben Zeitraum 23,79 %. (Die Performance für alle Anteilsklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamterrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividenderträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Im vergangenen Jahr überraschten die globalen Aktienmärkte die meisten Prognostiker mit gesunden, positiven Renditen. Die Anleger nahmen die geopolitischen Konflikte anstandslos hin, und auf makroökonomischer Ebene stützten die in den meisten großen Volkswirtschaften gesunden Arbeitsmärkte weiterhin den weltweiten Konsum (außer in China). Da sich die Lieferketten weiter normalisierten, ließ der Inflationsdruck weiter nach.
- Die Performance von Unternehmen war uneinheitlich, wobei sowohl makroökonomische Ängste als auch die langwierigen Folgen der Ungleichgewichte durch COVID-19 die Ergebnisse beeinträchtigten.
- Wir denken, dass die Bewertungsverzerrungen an den Aktienmärkten fortbestehen. „Indexlieblinge“ und „Story-Aktien“ werden weiterhin mit hohen Multiplikatoren bewertet, während viele andere Unternehmen auf der Strecke bleiben.
- Die impliziten Werte einer beträchtlichen Anzahl unserer Unternehmen im Portfolio spiegeln weiterhin ein hohes Maß an Zukunftsunsicherheit wider, eine ermutigende Grundlage für geduldige Anleger.

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

- Positivbeiträge zur absoluten Rendite:
 - Die besten Wertbeiträge kamen u. a. von Expedia Group, Uber (beide Globaler Verbrauch) und Vistra Corp. (Energieinfrastruktur).
- Negativbeiträge zur absoluten Rendite:
 - ModivCare (Health & Wohlbefinden), Alibaba (Globaler Verbrauch) und Criteo (Smart Systems) gehörten zu den Titeln verantwortlich für mit die größten Abzüge von der Performance.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Im vergangenen Jahr haben wir zwei neue Unternehmen in das Portfolio aufgenommen, nämlich Uber (Globaler Verbrauch) und Element Solutions (Energieeffizienz), und unser Engagement bei ModivCare (Health & Wohlbefinden) und Criteo (Smart Systems) erhöht.
- Wir finanzierten diese Investitionen durch die Reduzierung oder Beendigung unserer Beteiligungen an Quanta Services (Energieinfrastruktur), AON (Health & Wohlbefinden), Element Fleet Management (Energieeffizienz) und Paya Holdings (Globaler Verbrauch). Letzterer Titel wurde zu Anfang des Jahres erworben.

Wir sind weiterhin von unseren Portfoliobeständen begeistert. Es wird erwartet, dass diese Unternehmen in den kommenden Jahren zwar ein jährliches Wachstum des freien Cashflows von 23 % erzielen werden, aber zu sehr hohen freien Cashflow-Renditen gehandelt werden. Tatsächlich handelt es sich um Bewertungen, die wir seit langem nicht mehr gesehen haben. Diese Konstellation bietet ein attraktives Risiko-Ertrags-Verhältnis, das unserer Meinung nach mit einer erheblichen Sicherheitsmarge kommt. Darüber hinaus ist es ermutigend, dass viele Portfoliounternehmen an „Effizienz“ gewinnen, z. B. durch Technologien, Produkte und Dienstleistungen, die es ihren Kunden ermöglichen, „mehr mit weniger“ zu erreichen. Dies ist zwar immer ein wertvolles Geschäftskonzept, aber zu Zeiten des wirtschaftlichen Abschwungs ist es besonders wichtig.

Global Flexible Credit Income – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD 1 12,52 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividenden erträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- In dem Bemühen, die Inflation zu bekämpfen, setzten die Zentralbanken der Industrieländer ihren Zinserhöhungszyklus fort. Die Federal Reserve und die Europäische Zentralbank hoben die Leitzinsen um 100 Bp bzw. 200 Bp an.
- Die Zinsvolatilität war das ganze Jahr über hoch. Im November und Dezember, als die Inflation im Griff zu sein schien und eine Verlangsamung des Wachstums erwartet wurde, preiste der Markt zunehmend aggressive Zinssenkungen in der nahen Zukunft ein. Dies führte zu einer erheblichen Rally bei Staatsanleihen und Risikoanlagen.
- Die Kreditspreads verengten sich im Berichtszeitraum, was auf eine besser als erwartete Wirtschaftsleistung und eine stetige Nachfrage nach Unternehmensanleihen zurückzuführen ist. Die Kreditspreads für US-amerikanische Unternehmensanleihen mit und ohne Investment Grade (IG) verengten sich um 32 Bp bzw. 122 Bp.

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

- Positivbeiträge zur absoluten Rendite:
 - Das Engagement in Hochzinsanleihen aus Industrie- und Schwellenländern leistete den größten Wertbeitrag.
 - Die Engagements bei Investment-Grade-Unternehmensanleihen und besicherten Schuldtiteln (Collateralized Loan Obligations) generierten einen untergeordneten Wertbeitrag.
 - Das Engagement in verbrieften Krediten leistete einen kleinen positiven Wertbeitrag.
- Negativbeiträge zur absoluten Rendite:
 - Aus Sektorperspektive gab es keine wesentlichen Negativbeiträge.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio war in verschiedenen Kreditsektoren sowie über Ratingkategorien und Regionen investiert.
- Wir haben unser Engagement in US_Hochzinstiteln heruntergefahren und erhöhten unsere Gewichtung von europäischen Hochzinsanleihen, Schwellenländeranleihen, europäischen Investment-Grade-Unternehmensanleihen und verbrieften Krediten.
- Wir haben die Duration des Portfolios um etwa ein dreiviertel Jahre erhöht.

Angesichts der sich verbessernden Inflationstendenzen und dem Umstand, dass die Zinssätze der Zentralbanken wahrscheinlich ihren Höchststand erreicht haben, sind wir der Auffassung, dass das wirtschaftliche Wachstum immer wichtiger für die Renditen festverzinslicher Wertpapiere wird. Wir bevorzugen das Halten von festverzinslichen Wertpapieren mit einer Laufzeit von bis zu fünf Jahren, um die noch immer hohen Zinsen zu sichern, bevor sie wieder sinken. Wir erwarten, dass sich die Zweiteilung der Kreditmärkte zugunsten von Qualität fortsetzen wird. Insgesamt glauben wir, dass 2024 eine lohnende Zeit für solche globale Anleiheinvestoren sein könnte, die sich beim Aufbau ihrer Portfolios auf Fundamentaldaten und Selektivität konzentrieren.

Global High Yield SDG Engagement – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 10,29 %. Der als Benchmark dienende ICE BofA Global High Yield Constrained Index (Total Return, Hedged,USD) (der Index) verbuchte im selben Zeitraum 12,97 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Der globale Markt für Hochzinsanleihen beendete den Berichtszeitraum mit starken Renditen, die von der Risikobereitschaft gegen Jahresende angetrieben wurden, als die Spreads zurückgingen und die Märkte für 2024 trotz robuster Wirtschaftsdaten Zinssenkungen einpreisten. Für das Kalenderjahr 2023 waren die Renditen von Hochzinsanleihen die höchsten seit 2019.
- Abgesehen von den risikoreicheren osteuropäischen und chinesischen Immobiliensektoren hielten sich die aggregierten Fundamentaldaten von Hochzinsemitenten in Bezug auf das Wachstum des Gewinns vor Zinsen, Steuern und Abschreibungen, der freie Cashflow, die Zinsdeckung und der Verschuldungsgrad einem recht günstigen Bereich, und die Ertragsaison fiel im Großen und Ganzen besser aus als befürchtet. Die Aussichten in Bezug auf Zahlungsausfälle blieben ebenfalls relativ günstig.
- Es wird erwartet, dass die Ausfallquoten in den USA, in Europa und anderen Industrieländern durchschnittlich bleiben werden, nachdem sie sich von den im Jahr 2022 erreichten historischen Tiefstständen nach oben bewegt haben. Die Ausfälle in Schwellenländern (EM) haben zwar zugenommen, aber wir konzentrieren uns auf ausgewählte Gelegenheiten außerhalb der Regionen und Sektoren mit einem höheren Risiko. Unsere Erwartung eines in etwa durchschnittlichen Ausfallrisikos stützt sich auf unsere Bottom-up-Beurteilung von Emittenten und wird getragen von dem qualitativ höherwertigen Ratingsmix im globalen Hochzinssegment (56 % der Emittenten mit Kreditratings von BB), von weniger aggressiven Neuemissionen, weniger kurzfristigen Fälligkeiten sowie einem Energiesektor, der deutlich solider ist als in den letzten Zyklen.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Aus sektoraler Sicht: Positionierungen in den Segmenten Auto, Baustoffe und Chemie.
 - Aus der Sicht der Ratings eine Untergewichtung von Emittenten mit BB-Rating.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Aus Sektorsicht Positionierung in den Bereichen Energie, Festnetz und sonstige Finanzwerte.
 - Aus der Perspektive der Ratings: Positionierung in Emittenten mit einem Rating von B, CCC und darunter sowie BB.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

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

Wir sind der Meinung, dass die Bewertungen von Hochzinsanleihen eine mehr als angemessene Entschädigung für die mehr oder weniger durchschnittlichen Ausfallerwartungen darstellen, die Anleihen weiterhin dauerhafte Erträge bieten und im Vergleich zu anderen festverzinslichen Alternativen attraktiv sind. Da die Kreditstreuung zugenommen hat, konzentrieren sich unsere Analysten auf die spezifischen Fundamentaldaten individueller Emittenten und bewerten die Basis- und Abwärtsszenarien im Falle einer weichen Landung oder Rezession. Trotz potenzieller kurzfristiger Volatilität, die sich aus der Unsicherheit in Bezug auf das Wirtschaftswachstum ergibt, sind wir der Meinung, dass wir mit unserem fundamentalen Bottom-up-Kreditresearch – mit Konzentration auf die Auswahl von Wertpapieren, die Vermeidung von Bonitätsherabstufungen und die ausschließliche Aufnahme der „besten Ideen“ in die Portfolios – gut aufgestellt sind, um von eventueller Volatilität zu profitieren.

Global High Yield Sustainable Action* – Bericht des Investment-Managers

Für den Zeitraum vom 1. Januar 2023 bis zur Schließung des Portfolios am 16. Juni 2023 betrug die Gesamrendite für die Thesaurierende Klasse USD I 4,32 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Der globale Markt für Hochzinsanleihen beschloss den Berichtszeitraum mit soliden Renditen, die vor allem darauf beruhten, dass die Wirtschaftsdaten robuster ausfielen als erwartet, aber auch auf die Erträge der meisten Emittenten. Das galt ungeachtet der Volatilitätsschübe, die von Sorgen um höhere Inflation ausgelöst wurden, der restriktiveren Zentralbankpolitik, der Minibankenkrise und des zunehmenden Rezessionsrisikos im ersten Halbjahr.
- Die Ausfallquoten in den USA, in Europa und anderen Industrieländern dürften durchschnittlich bleiben, nachdem sie sich von den im Vorjahr erreichten historischen Tiefstständen nach oben bewegt haben. Die Ausfälle in Schwellenländern (EM) nehmen zwar zu, aber wir konzentrieren uns auf ausgewählte Gelegenheiten außerhalb der Regionen und Sektoren mit höherem Risiko. Bei EM-Hochzins-Unternehmensanleihen betrug die Ausfallquote insgesamt in diesem Jahr anfangs um die 15 Prozent. Grund dafür sind ausbleibende Zahlungen russischer und ukrainischer Emittenten und die erhöhte Zahl an Ausfällen im chinesischen Immobiliensektor. Abgesehen von diesen spezifischen Bereichen rechnen wir mit einer eher gemäßigten Ausfallquote für hochverzinsliche EM-Unternehmensanleihen, da die EM-Unternehmen mit einer im Durchschnitt angemessenen Liquidität in diesen Zeitraum eintraten.

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

- Positivbeiträge zur absoluten Rendite:
 - Die Positionierung in Emittenten mit B-, BB-, CCC- und schlechteren Ratings sowie mit BBB- und besseren Ratings.
 - Die Positionierung in den Sektoren Support-Dienstleistungen, Gesundheitswesen und Baustoffe.
- Negative, neutrale oder besonders geringe Beiträge zur absoluten Rendite:
 - Die Positionierung in Emittenten ohne Rating wirkte ergebnisneutral.
 - Die Positionierung im Sektor Medien und Kabel minderte die Wertentwicklung.
 - Die Sektoren Druck und Verlagswesen sowie Papier steigerten die Erträge am geringsten.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio wurde am 16. Juni 2023 geschlossen.

* Das Portfolio wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

Global Investment Grade Credit – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamterrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD 1 9,60 %. Der Bloomberg Global Aggregate Corporate Index (Total Return, abgesichert, USD) (der Index) rentierte im selben Zeitraum 9,10 %. (Die Performance für alle Anteilsklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamterrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Das Jahr 2023 begann mit einer erheblichen Volatilität an den Kreditmärkten, wobei sich die Spreads einengten. Der Grund war die erwartete Abschwächung der US-Inflation und der Aussichten auf eine Verbesserung des globalen Wachstums nach der überraschenden Ankündigung Chinas, seine Wirtschaft rasch wieder öffnen zu wollen. Anfang März weiteten sich die Kreditspreads aufgrund von Ereignissen im Bankensektor: die Silicon Valley Bank wurde am 10. März unter Konkursverwaltung gestellt und die Schweizer Regierung vermittelte am 19. März die Übernahme der Credit Suisse durch die UBS. Später in der ersten Jahreshälfte ließen die Bedenken im Bankensektor nach, nachdem sich herausgestellt hatte, dass andere regionale US-Banken sowie global systemrelevante Banken besser von diesem Druck abgeschirmt waren.
- Die angespannten Finanzbedingungen hielten an, da der Bankensektor unter Druck geriet und großen Zentralbanken im Laufe des Jahres die Leitzinsen erhöhten, wobei sie auf die nach wie vor hohen Inflationsraten verwiesen. Die Federal Reserve erhöhte das Zielband für die Leitzinsen von 4,5 % bis 4,75 % zu Beginn des Jahres 2023 auf 5,25 % bis 5,5 % im Juli 2023 und hielt es auf diesem Niveau. Die Europäische Zentralbank erhöhte den Satz für die Einlagefazilität von 2,00 % im Januar 2023 auf 4,00 % im September 2023 und hielt den Satz seitdem ebenfalls konstant. Schließlich hat dann auch die Bank of England den britischen Leitzins im Laufe des Jahres um 175 Basispunkte auf 5,25 % im August 2023 angehoben und seitdem beibehalten. Alle großen Zentralbanken bestätigten, dass die Geldpolitik derzeit restriktiv ist, wodurch ein Abwärtsdruck auf die Inflation ausgeübt werden soll.
- Als der Höchststand der Zinsen in Sichtweite kam, gaben die Renditen von Staatsanleihen im vierten Quartal nach, was den Anstieg vom Jahresanfang wieder wettmachte. Insbesondere hielt die Fed auf ihrer letzten Sitzung im Jahr 2023 die Zinssätze bei 5,25 % bis 5,50 % konstant. Im Anschluss an die geldpolitische Sitzung räumte die Fed in ihrer Stellungnahme ein, dass sich die Wirtschaftstätigkeit gegenüber dem dritten Quartal verlangsamt habe. Der Arbeitsmarkt sei zwar immer noch stark, doch habe er sich abgeschwächt und die Arbeitslosenquote bleibe niedrig. Die Prognosen der Fed gehen nun von drei möglichen Zinssenkungen im Jahr 2024 aus. Die „Kehrtwende“ der Fed hinsichtlich der Zinserwartungen löste zum Jahresende eine deutliche Rally an den Renten- und Aktienmärkten aus.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Vorrangige unbesicherte Anleihen aus den Sektoren Technologie und Kommunikation, Grundstoffe, Immobilien und Konsumgüter trugen zur Outperformance bei.
 - Nachrangige Tier-2-Schuldtitle von Versicherungsunternehmen leisteten ebenfalls einen positiven Beitrag zur Performance.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Demgegenüber schmälerte der Bankensektor die Performance leicht.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Wir beteiligten uns im Jahr 2023 an einer Reihe attraktiv bepreister Neuemissionen auf dem Primärmarkt, die dem Portfolio eine starke relative Outperformance bescherten. Wir erwarben nachrangige Tier-2-Bankanleihen großer national führender britischer und europäischer Institute und stockten in volatilen Marktphasen Anfang März 2023 auch Positionen in US-Großbanken auf, die für uns einen hohen Überzeugungsgrad aufweisen. Unsere Position in den erstrangigen unbesicherten Holdco-Anleihen der Credit Suisse behielten wir bei. Diese verzeichnete eine rasche Verengung der Spreads nach der ausgehandelten Übernahme durch die UBS mit erheblicher Spread-Outperformance.
- Die Durationspositionierung des Portfolios wurde im Jahresverlauf weitgehend in der Nähe des Benchmarkniveaus beibehalten. Wir haben jedoch in Zeiten mit einer relativen Unterperformance der Renditen auf in Pfund Sterling denominated Unternehmensanleihen in der ersten Hälfte des Jahres 2023 unsere Durationspositionierung in Pfund Sterling nach oben gefahren. Außerdem erhöhten wir die Durationspositionierung des Portfolios in US-Dollar im dritten Quartal 2023, als sich die Renditen von US-Unternehmensanleihen auf relativer Basis unterdurchschnittlich entwickelten.

Zum Start in das Jahr 2024 bleiben wir übergewichtet in manchen der defensiveren Sektoren wie Versorger und Banken sowie in einigen zyklischen Sektoren mit höherem Beta wie Immobilien. Wir bleiben übergewichtet in Sektoren mit starken Fundamentaldaten, die sich derzeit im Verschuldungsabbau befinden, wie Kommunikationsdienste, die unseres Erachtens weiterhin von einem von steigenden Zinsen geprägten Umfeld profitieren sollten. Wir sind untergewichtet in Sektoren wie nicht-zyklische Konsumgüter, die wir für stärker gefährdet einschätzen, Fremdkapital zur Finanzierung von Aktionärsrenditen über Aktienrückkäufe und M&A-Aktivitäten einzusetzen und die zu relativ angespannten Bewertungen gehandelt werden.

Global Opportunistic Bond – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD 16,23 %. Der als Benchmark dienende Bloomberg Global Aggregate Index (Total Return, Hedged, USD) (der Index) verbuchte im selben Zeitraum 7,15 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividenderträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- In dem Bemühen, die Inflation zu bekämpfen, setzten die Zentralbanken der Industrieländer ihren Zinserhöhungszyklus fort. Die Federal Reserve und die Europäische Zentralbank hoben die Leitzinsen um 100 Bp bzw. 200 Bp an.
- Die Zinsvolatilität war das ganze Jahr über hoch. Im November und Dezember, als die Inflation im Griff zu sein schien und eine Verlangsamung des Wachstums erwartet wurde, preiste der Markt zunehmend aggressive Zinssenkungen in der nahen Zukunft ein. Dies trug zu einer erheblichen Rally bei Staatsanleihen und Aktien bei.
- Die Kreditspreads verengten sich im Berichtszeitraum, was auf eine besser als erwartete Wirtschaftsleistung und eine stetige Nachfrage nach Unternehmensanleihen zurückzuführen ist. Die Kreditspreads für globale Unternehmensanleihen mit und ohne Investment Grade verengten sich um 32 Bp bzw. 122 Bp.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Die Allokationen zu europäischen Hochzinstiteln, Schwellenländeranleihen und Kreditrisikotransfer.
 - Einzeltitelauswahl bei globalen Unternehmensanleihen mit Investment Grade und quasistaatlichen Mortgage Backed Securities (MBS).
 - Die Übergewichtung von quasistaatlichen MBS.
 - Das aktive Devisen-Overlay des Portfolios.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Die Untergewichtung in globalen Unternehmensanleihen mit Investment Grade.
 - Eine Untergewichtung von gedeckten Anleihen.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Im Laufe des 12-Monatszeitraums erhöhten wir unser Engagement in quasistaatlichen MBS und Unternehmensanleihen mit Investment Grade und reduzierten die Gewichtung von globalen Hochzinsanleihen und Schwellenländeranleihen.
- Im zweiten Quartal gingen wir von einer untergewichteten zu einer übergewichteten Duration über. Zum Jahresende behielten wir die Übergewichtung auf einem etwas niedrigeren Niveau bei, da wir nach dem Anstieg der Renditen auf Staatsanleihen im vierten Quartal die Gewinne mitnahmen.

Angesichts der sich verbessernden Inflationstendenzen und dem Umstand, dass die Zinssätze der Zentralbanken wahrscheinlich ihren Höchststand erreicht haben, sind wir der Auffassung, dass das wirtschaftliche Wachstum immer wichtiger für die Renditen festverzinslicher Wertpapiere wird. Wir bevorzugen das Halten von festverzinslichen Wertpapieren mit einer Laufzeit von bis zu fünf Jahren, um die noch immer hohen Zinsen zu sichern, bevor sie wieder sinken. Wir erwarten, dass sich die Zweiteilung der Kreditmärkte zugunsten von Qualität fortsetzen wird. Insgesamt glauben wir, dass 2024 eine lohnende Zeit für solche globale Anleiheinvestoren sein könnte, die sich beim Aufbau ihrer Portfolios auf Fundamentaldaten und Selektivität konzentrieren.

Global Real Estate Securities – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtertragsrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD 17,65 %. Die Benchmark, der FTSE EPRA/Nareit Developed Real Estate Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) verbuchte im gleichen Zeitraum 9,74 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtertragsrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Der globale Aktienmarkt erlebte im Laufe des Jahres einen signifikanten Aufschwung, unterstützt durch ein besseres Wirtschaftswachstum, eine nachlassende Inflation und die Erwartung weiterer geldpolitischer Lockerungen durch die großen Zentralbanken.
- Die Verschärfung der Kreditbedingungen im Anschluss an die regionale Bankenkrise in den USA und die geringen Transaktionsvolumina drückten die Stimmung in Bezug auf Immobilien, doch wurde sie durch die starken Signale, dass die Zinssätze ihren Höhepunkt erreicht haben, verbessert.
- Eine deutliche Markterholung ab Ende Oktober ließ die Rendite des Index auf das Jahr gerechnet auf ein Plus von 9,74 % ansteigen, während der MSCI ACWI im gleichen Zeitraum eine Rendite von 22,20 % verbuchte.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Eine Übergewichtung von Spanien und eine Untergewichtung von Japan.
 - Die Einzeltitelauswahl im Sektor Büroraum.
 - Die Einzeltitelauswahl im Sektor Wohnraum.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Eine Untergewichtung gegenüber den USA und Deutschland.
 - Die Einzeltitelauswahl im Sektor Einzelhandel.
 - Die Einzeltitelauswahl im Sektor Immobilien-Holdings und Bauträger.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Der Sektorpositionierung des Portfolios lag überwiegend eine Bottom-up-Einzeltitelauswahl zugrunde. Am Ende des Berichtszeitraums bestanden die größten Übergewichtungen im Verhältnis zum Index in den Sektoren Infrastruktur-REITs und Selbsteinlagerung. Die im Portfolio gegenüber dem Index am stärksten untergewichteten Sektoren waren Diversified und Büroraum.
- Nach Ländern bestanden die größten Übergewichtungen im Vereinigten Königreich und in Spanien, die größten Untergewichtungen in den USA und in Australien.

Nach einem schwierigen Jahr 2023, das weitgehend von der geldpolitischen Straffungskampagne der US-Notenbank diktiert wurde, erscheint uns das Zinsumfeld für 2024 vielversprechend. Die US-Notenbank legt in der ersten Jahreshälfte 2024 weitgehend eine Pause ein und die Anleger rechnen mit Zinssenkungen in der zweiten Jahreshälfte. Dies geschieht allerdings vor dem Hintergrund einer größeren wirtschaftlichen Unsicherheit. Die meisten europäischen Unternehmen machten bei ihren Initiativen zum Schuldenabbau Fortschritte und konnten Verkäufe von notleidenden Vermögenswerten oder größere Kreditherabstufungen vermeiden. Wir erwarten, dass sich die Aussichten der Unternehmen im Jahr 2024 weiter verzweigen werden. Auf der einen Seite nimmt der Refinanzierungsdruck für schwächere Unternehmen zu, während auf der anderen Seite stärkere Unternehmen mit höherwertigen Vermögenswerten neue Investitionen in attraktiven Sektoren wie Studentenwohnungen, Selbsteinlagerung, Datenzentren und Logistik tätigen. In Asien war Japan ein Lichtblick, doch scheint die Erholung der Aktien eher die positiven Aussichten widerspiegelt zu haben. Australien und Singapur wiesen stabile Fundamentaldaten auf. Im Fall von Hongkong bereiten die sinkenden Hauspreise und die indirekten Auswirkungen der geopolitischen Spannungen auf die chinesische Wirtschaft die meisten Sorgen. Der allgemeine Druck sollte dazu führen, dass den Bewertungen, der Ertragsqualität und der Stärke der unternehmerischen Fundamentaldaten mehr Aufmerksamkeit geschenkt wird, und unserer Meinung nach wird dies gut kapitalisierten REITs in ausgewählten Sektoren zugute kommen, deren Nachfrage weniger zyklisch oder nicht übermäßig verbraucherabhängig ist.

Global Sustainable Equity – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtertragsrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD 1 23,78 %. Der als Benchmark dienende MSCI World Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) verzeichnete im selben Zeitraum 23,79 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtertragsrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die Aktienmärkte begannen das Jahr 2023 mit einer kräftigen Erholung, da sich die Inflation abschwächte, doch gab es auch Gegenwind durch die Zentralbanken, die die Zinssätze im Laufe des Jahres weiter anhoben.
- Gegen Mitte des Jahres führten Rezessionsängste und Spannungen im Finanzsektor, einschließlich des Zusammenbruchs namhafter Banken zu Beginn des Jahres, zu einer erhöhten Volatilität und Marktschwäche.
- Die Märkte beendeten das Jahr jedoch mit einer robusten Performance, unterstützt durch den Optimismus hinsichtlich einer gelockerten Geldpolitik und sinkender langfristiger Zinsen, da der Inflationsdruck nachließ.
- Die US-Wirtschaft zeigte starkes Wachstum, im Gegensatz zu Europa und Japan, wo sich die Konjunktur abschwächte.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Eine Übergewichtung gegenüber dem Index in den Sektoren Kommunikationsdienstleistungen und IT.
 - Die Einzeltitelauswahl unter Finanzwerten.
 - Auf Aktienebene trugen unsere Beteiligungen an 3i Group (Finanzen), Amazon.com (Nicht-Basiskonsumgüter), Alphabet Inc (Kommunikationsdienste), Adobe und Microsoft Corporation (IT) am meisten zur Performance bei.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Die Einzeltitelauswahl in den Sektoren IT und Basiskonsumgüter.
 - Eine Untergewichtung von Versorgern, Werkstoffen, Immobilien und vor allem Energie.
 - Estée Lauder, Bakka Frost (Basiskonsumgüter), Alfen (Industrie) und SolarEdge Technologies (IT) waren für die größten Wertabzüge von der Performance verantwortlich.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Wir haben Synopsis, einen Hersteller von Software für das Halbleiterdesign, in das Portfolio aufgenommen. Das Unternehmen wird ein wichtiger Nutznießer der weiteren Digitalisierung der Gesellschaft sein, einschließlich der KI-Einführung.
- Ebenfalls hinzu kam L'Oréal, da wir davon ausgehen, dass seine sehr starke Position auf dem Schönheitsmarkt und seine kontinuierlichen Innovationsinitiativen zum Gewinn von Marktanteilen führen werden.
- Die Position in Match, einem Anbieter von Dating Services, wurde aufgrund der Unklarheit über das Abonnentenwachstum von Tinder und die zu erwartenden Herausforderungen durch Kundenabwanderung und eine sich abschwächende Wirtschaft aufgegeben.

Das wirtschaftliche Umfeld stellt weiterhin eine Herausforderung dar, mit Unsicherheiten in Bezug auf Inflation, die Zentralbankpolitik, Wahlergebnisse und geopolitische Entwicklungen. In diesem Zusammenhang gehen wir weiterhin davon aus, dass unser Ansatz der richtige ist: die Verwaltung eines fokussierten Portfolios von Qualitätsunternehmen mit einer dauerhaften Wettbewerbsposition, einem starken Management wesentlicher ESG-Aspekte und der Fähigkeit, sich an Veränderungen anzupassen. Wir glauben, dass solche Unternehmen, die wir als „Transition Winners“ bezeichnen, gut gerüstet sind, um langfristig zu wachsen. Dies gilt umso mehr in unsicheren Zeiten, da der Fokus dieser Unternehmen auf Nachhaltigkeit ihren Wettbewerbsvorteil weiter stärkt.

Global Sustainable Value – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamterrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD 1 16,70 %. Im selben Zeitraum erzielten der MSCI All Country World Value Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der „übergeordnete Index“) und der MSCI All-Country World Index (ACWI) (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der „Sekundärindex“) eine Rendite von 11,81 % bzw. 22,20 %. (Die Performance für alle Anteilsklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamterrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividenden erträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die globalen Aktienmärkte erholten sich in diesem Jahr, da die Möglichkeiten der KI die Renditen antrieb, während die weltweit nachlassende Inflation die Marktstimmung für den Rest des Jahres 2023 optimistisch stimmte.
- Die US-Notenbank, die Europäische Zentralbank und die Bank of England hoben die Zinsen im Laufe des Jahres kontinuierlich an und signalisierten einen möglichen Zinssenkungszyklus im Jahr 2024.
- Die „Glorreichen Sieben“¹ trugen sowohl in den USA als auch weltweit am meisten zur Stärke bei.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Die Übergewichtung im IT-Sektor gegenüber dem übergeordneten Index.
 - Die Einzeltitelauswahl im Sektor Kommunikationsdienste und Industrie.
 - Die Einzeltitelauswahl in den Vereinigten Staaten.
 - Die Faktoren Qualität, Momentum und Volatilität.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Die Untergewichtung von Finanzwerten gegenüber dem übergeordneten Index.
 - Die Einzeltitelauswahl im Gesundheitswesen.
 - Die Einzeltitelauswahl in Schwellenmärkten und in Japan.
 - Die Substanzfaktoren und Dividendenrendite.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio behielt seine Übergewichtung im Sektor IT bei. Dabei konzentrierte sich der Großteil des Engagements auf Halbleiter und Hardware, wo wir die meisten Value-Kandidaten innerhalb des Sektors finden.
- Das Portfolio war im Jahr 2023 auf rentable Aktien mit geringerer Duration ausgerichtet, während die hohe Inflation im Laufe des Jahres zurückging und die Zinsen erst stiegen und dann stagnierten.

Mit Eintritt in das Jahr 2024 denken wir, dass das Portfolio für das Marktumfeld gut positioniert ist. Wir sind der Meinung, dass der historische Kompromiss zwischen Zinsen und Inflation wiederhergestellt ist, was unsere Portfoliopositionierung zugunsten attraktiver und rentabler Unternehmen unterstützen könnte. Darüber hinaus sind wir der Ansicht, dass der Schwerpunkt des Portfolios auf eine gute Kapitaldisziplin angesichts der Kreditverknappung und der unter Druck stehenden Unternehmensgewinne ebenfalls von Vorteil sein könnte.

¹ Die „Glorreichen Sieben“ ist ein Spitzname für sieben technologiebezogene Mega-Caps aus dem Wachstumssegment, die deutlich besser abgeschnitten haben als der Rest der Aktien im S&P 500® Index, und setzten sich aus Alphabet (Klasse A & C), Amazon.com, Apple, Meta Platforms, Microsoft, NVIDIA und Tesla zusammen.

High Yield Bond – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 11,36 %. Der als Benchmark dienende ICE BofA US High Yield Constrained Index (Total Return, USD) (der Index) verbuchte im selben Zeitraum 13,47 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Der Markt für Hochzinsanleihen beendete 2023 mit starken Renditen, die von der Risikobereitschaft gegen Jahresende angetrieben wurden, als die Spreads zurückgingen und die Märkte für 2024 trotz robuster Wirtschaftsdaten Zinssenkungen einpreisten. Für das Kalenderjahr 2023 waren die Renditen von Hochzinsanleihen die höchsten seit 2019.
- Die aggregierten Fundamentaldaten von Hochzinsemitenten in Bezug auf das Wachstum des Gewinns vor Zinsen, Steuern und Abschreibungen, der freie Cashflow, die Zinsdeckung und der Verschuldungsgrad, hielten sich in einem recht günstigen Bereich, und die Ertragssaison fiel im Großen und Ganzen besser aus als befürchtet. Die Aussichten in Bezug auf Zahlungsausfälle bleiben ebenfalls relativ günstig.
- Zwar ist die Ausfallquote von ihren Tiefstständen im Jahr 2022 gestiegen, doch erwarten wir für 2024, dass die Ausfallquoten in einem Bereich knapp unter dem langfristigen Durchschnitt bleiben werden. Dieser Ausblick stützt sich auf unsere Bottom-up-Beurteilung von Emittenten und wird getragen von dem qualitativ höherwertigen Ratingsmix im Hochzinssegment (48 % der Emittenten mit Kreditratings von BB), von weniger aggressiven Neuemissionen, weniger kurzfristigen Fälligkeiten sowie einem Energiesektor, der deutlich solider ist als in den letzten Zyklen.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Aus sektoraler Sicht trugen die Positionierungen in den Sektoren Pharma, Chemie und Auto am meisten zur Performance im Berichtszeitraum bei. Aus Perspektive der Ratings leisteten die Positionierungen bei BB-Papieren und Emittenten ohne Rating den besten Wertbeitrag zur Performance im Berichtszeitraum.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Aus sektoraler Sicht trugen die Positionierungen in den Sektoren Technologie, Festnetz und Einzelhandel am meisten zur Performance im Berichtszeitraum bei. Aus Sicht der Ratings beeinträchtigten Titel mit CCC-Rating und darunter, BBB und darüber sowie mit B bewertete Emittenten die Performance am stärksten.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

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

Wir sind der Meinung, dass die Bewertungen von Hochzinsanleihen eine mehr als angemessene Entschädigung für die mehr oder weniger durchschnittlichen Ausfallerwartungen darstellen, die Anleihen weiterhin dauerhafte Erträge bieten und im Vergleich zu anderen festverzinslichen Alternativen attraktiv sind. Da die Kreditstreuung zugenommen hat, konzentrieren sich unsere Analysten auf die spezifischen Fundamentaldaten individueller Emittenten und bewerten die Basis- und Abwärtsszenarien im Falle einer weichen Landung oder Rezession. Trotz potenzieller kurzfristiger Volatilität, die sich aus der Unsicherheit in Bezug auf das Wirtschaftswachstum ergibt, sind wir der Meinung, dass wir mit unserem fundamentalen Bottom-up-Kreditresearch – mit Konzentration auf die Auswahl von Wertpapieren, die Vermeidung von Bonitätsherabstufungen und die ausschließliche Aufnahme der „besten Ideen“ in die Portfolios – gut aufgestellt sind, um von eventueller Volatilität zu profitieren.

InnovAsia 5G – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 31,93 %. Der als Benchmark dienende MSCI All Country Asia (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) verbuchte im selben Zeitraum ein Plus von 11,07 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Das langsamere Zinserhöhungstempo der Federal Reserve führte zu einer allgemeinen Outperformance von Tech- und Growth-Werten.
- Die mit der Wiedereröffnung der chinesischen Wirtschaft nach Covid verbundenen Hoffnungen zu Beginn des Jahres schwanden, und die Stimmung verschlechterte sich angesichts einer unerwartet langsamen Erholung und begrenzter Konjunkturmaßnahmen
- Geopolitische Spannungen verstärkten die Marktvolatilität und beschleunigten die Umgestaltung der Lieferketten.
- KI wurde zu einem Anlagethema, was zu einer Rally bei den Titeln mit entsprechenden Engagements in der asiatischen Technologie-Lieferkette führte.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Die Einzeltitelauswahl in Japan und Indien, die Untergewichtung von China und die Übergewichtung von Taiwan und Südkorea gegenüber dem Index.
 - Die Einzeltitelauswahl und die Übergewichtung von Halbleitern sowie von Technologie-Hardware & Ausrüstung gegenüber dem Index.
 - KI-Gewinner unter besonders leistungsstarken Anbietern von Halbleitern, Hardware und Hochgeschwindigkeitsnetzen.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Das Engagement in China in der ersten Jahreshälfte.
 - Die Einzeltitelauswahl in Medien & Unterhaltung.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das erhöhte Engagement im Halbleitersegment, aufgrund eines steigenden strategischen Werts und da die Talsohle der Zyklichkeit erreicht ist.
- Ein erhöhtes Engagement im Bereich Hardware/Komponenten im ersten bis dritten Quartal aufgrund von KI-Trends und Gewinnmitnahmen im vierten Quartal.
- Ein erhöhtes Engagement bei Industrierwerten aufgrund der soliden Aussichten in den Bereichen Automatisierung und erneuerbare Energien.
- Eine deutliche Reduzierung des Engagements in China und Umschichtung nach Indien und Südkorea.
- Wir nahmen die Gewinne des Engagements in Taiwan in der zweiten Jahreshälfte nach einer starken Performance mit.

Während das Ende des Zinserhöhungszyklus in Sicht ist, könnte die makroökonomische Unsicherheit anhalten. Wir setzen daher weiterhin auf Qualität, sind aber durchaus bereit, taktische Gelegenheiten zu nutzen und uns für zyklisches Wachstum zu positionieren. Wir sind in Bezug auf die Wachstumschancen in Asien optimistisch, vor allem bei modernsten Halbleitern, durch strukturelles Wachstum in KI, robuste Investitionsausgaben bei 5G und Datenzentren sowie die starke Zunahme Lifestyle-bezogener digitaler Inhalte.

Japan Equity Engagement – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamterrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse JPY I 20,17 %. Der MSCI Japan Small Cap Index (Net) (Total Return, JPY) (der Index) verzeichnete im selben Zeitraum ein Plus von 21,09 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamterrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividenderträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Japanische Aktien verzeichneten in der ersten Jahreshälfte positive Zuflüsse ausländischer Anleger, da sich die makroökonomischen Fundamentaldaten, unterlegt von steigenden Löhnen und Verbraucherpreisen verbesserten, was auf ein baldiges Ende der jahrelangen Deflation hindeutet.
- In der zweiten Jahreshälfte verlor die Rally am japanischen Aktienmarkt an Fahrt, da die globalen Anleger spekulierten, dass die Bank of Japan (BOJ) ihre ultralockere Geldpolitik früher als erwartet anpassen könnte.
- Im vierten Quartal verzeichnete der japanische Markt für Small- und Mid-Caps (SMID), angeführt von Qualitäts- und Wachstumsunternehmen, positive Anlegerzuflüsse. Der Hintergrund war, dass die Märkte damit begannen, die Aussicht auf Zinssenkungen durch die Federal Reserve einzupreisen, während die BOJ ihre Geldpolitik unverändert beließ.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Die Einzeltitelauswahl innerhalb der Kernbestände in den Sektoren Immobilien und Finanzwerte.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Die Einzeltitelauswahl unter den Kernbeständen im Nicht-Basiskonsumgütersektor.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Obwohl der Finanz- und der Immobiliensektor aufgrund der Erwartung der weltweiten Anleger, dass die BOJ mit der Normalisierung ihrer Geldpolitik beginnen würde, einer erheblichen Volatilität ausgesetzt waren, waren wir weiterhin bei jenen Kernbeständen strategisch positioniert, die sowohl Wachstumspotenzial besitzen als auch Aussichten auf eine Steigerung der Kapitaleffizienz haben.
- Außerdem setzten wir unsere konstruktiven Dialoge mit wichtigen Holdinggesellschaften in den Sektoren Kommunikation und Industrie fort, was zu neuen Engagements führte.
- Unsere Beteiligungen im Sektor Nicht-Basiskonsumgüter bei Emittenten mit einem Engagement in China hatten aufgrund der verzögerten makroökonomischen Erholung ein schwieriges Jahr. Wir halten diese Unternehmen weiterhin für führend in ihren jeweiligen Branchen und werden danach streben, unsere Positionen erneut aufzubauen, sobald wir festgestellt haben, dass sich die Abwärtsrisiken in ihren Bewertungen niedergeschlagen.

Wir erwarten, dass wir von der japanischen Wirtschaft gegenüber dem Rest der Welt, wo die Aussichten weiterhin unsicher sind, Widerstandsfähigkeit sehen werden. Wir glauben, dass der japanische Yen eine graduelle Aufwertung erfahren könnte, da die BOJ eine Normalisierung der Geldpolitik anstrebt, während sich die Zentralbanken weltweit auf Zinssenkungen vorbereiten. Vor diesem Hintergrund sind wir der Ansicht, dass das Marktumfeld für aktives Stock-Picking auf dem unterbewerteten japanischen SMID-Markt günstiger sein wird. Die Unternehmen generieren größere Umsätze auf dem Heimatmarkt und versuchen, die Kapitaleffizienz durch Bilanzreformen zu verbessern, was ein wichtiges Ziel unserer Gespräche mit den Managementteams ist.

Macro Opportunities FX – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse EUR I 3,25 %. Der als Benchmark dienende ICE BofA 0-1 Year AAA Euro Government Index (Total Return, EUR) (der Index) verzeichnete im selben Zeitraum 2,46 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

Im Jahr 2023 bewegten sich die meisten wichtigen Währungen in relativ engen Bandbreiten. Der US-Dollar wurde über weite Strecken des Jahres auf einem starken Niveau gehandelt und profitierte davon, dass er eine der renditestärksten G10-Währungen ist und die US-Wirtschaft Outperformance verzeichnet. Als sich gegen Ende des Jahres die Daten abschwächten, richtete sich die Aufmerksamkeit auf die Erwartung, dass die US-Notenbank ihre Geldpolitik im Jahr 2024 deutlich lockern müsste, und der Dollar gab nach. Der japanische Yen war die schwächste der großen Währungen, denn die Bank of Japan hielt die Leitzinsen weiterhin bei 0 %, was die Kosten für das Halten des Yen gegenüber anderen Hauptwährungen verteuerte.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Übergewichtungen des australischen Dollars und des neuseeländischen Dollars trugen am meisten zur Performance bei
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Eine Untergewichtung der schwedischen Krone
 - Der japanische Yen

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Die Strategie verfolgte über das gesamte Jahr 2023 hinweg einen eher taktischen Handelsansatz.

Mit Blick auf das Jahr 2024 wird viel davon abhängen, ob die geldpolitische Lockerung einsetzen und welchen Umfang sie haben wird. Sollte dies nicht der Fall sein, würden wir erwarten, dass die Währungen weiterhin in engen Bandbreiten gehandelt werden.

Multi-Asset Income* – Bericht des Investment-Managers

Für den Zeitraum vom 1. Januar 2023 bis zur Schließung des Portfolios am 6. Juli 2023 betrug die Gesamrendite für die Thesaurierende Klasse USD I 2,95 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividenden erträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Obwohl die Zentralbank die geldpolitischen Zügel weiter anzog und eine Regionalbankenkrise einsetzte, zeigten sich die Wirtschaftsdaten robust. Das Wachstum ließ zwar nach, übertraf im Großen und Ganzen aber die Erwartungen. Die Inflation fiel von den erreichten Höchstwerten zurück, die Arbeitslosigkeit blieb niedrig und der Konsum rege.
- Am besten entwickelten sich die Aktienmärkte, angeführt von Megacap-Growth-Werten, beflügelt durch überschüssige Liquidität, Kapitalströme und Optimismus bezüglich KI und ihrer Auswirkungen.
- In den meisten Industrieländern gaben die Inflationswerte nach, was vor allem vorteilhaften Basiseffekten durch den Rückgang der Ölpreise von ihrem im Juni 2022 erreichten Hoch zuzuschreiben war, wenngleich die Kernraten hartnäckiger blieben. Im Vereinigten Königreich zogen die Löhne und die Preise für Kerndienstleistungen schneller an, was die Bank of England zu einem restriktiveren Vorgehen veranlasste.
- Die globalen Anleiherenditen erhöhten sich am kurzen Ende der Kurve. Das hatte in vielen Industrieländern eine stärkere Inversion der Renditekurve zur Folge. Unternehmensanleihen entwickelten sich gut, da sich die Spreads verengten. Titel mit niedrigerem Rating schnitten am besten ab, weil die Rezessionsgefahr auf kürzere Sicht zurückging.

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

- Positivbeiträge zur absoluten Rendite:
 - Auf hohe laufende Erträge ausgerichtete Strategien lieferten einen soliden Positivbeitrag zur Rendite, an dem sowohl Aktien- als auch Festzinskomponenten Anteil hatten. Auch die Optionsstrategie steigerte den Ertrag kräftig, da die Volatilität auf den Aktienmärkten abnahm.
 - Im Aktiensegment kam der größte Wertbeitrag von dividendenstarken Titeln aus Industrieländern, gefolgt von Aktien aus Schwellenländern („EM“).
 - Im festverzinslichen Bereich entwickelten sich europäische Hochzinsanleihen am besten. Dem lag eine Verengung der Spreads zugrunde. Auch Long-Strategien für Unternehmens-, Staats- und EM-Anleihen wirkten ausnahmslos ertragssteigernd.
- Negativbeiträge zur absoluten Rendite:
 - Die Komponente der unkorrelierten Strategien wies im Berichtszeitraum ein Minus aus, da taktische und strategische Anpassungen belastend wirkten. Das war auf Einschätzungen zu Short-Positionen in Aktien und Long-Positionen im japanischen Yen zurückzuführen.
 - Im Aktiensegment minderte die Allokation in alternative Aktienstrategien die Performance, da sowohl die Sparte börsennotierte Infrastruktur als auch REITs unterdurchschnittlich abschnitten.
 - Im festverzinslichen Segment entwickelte sich die Allokation in Vorzugspapiere am schwächsten, da Bankenstress den Finanzsektor überschattete, wovon insbesondere hybride Wertpapiere in Mitleidenschaft gezogen wurden.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio blieb breit gestreut über auf hohe laufende Erträge ausgerichtete Strategien, festverzinsliche Wertpapiere, hohe laufende Erträge abwerfende und alternative Aktien, Optionserträge und unkorrelierte Strategien.
- Im Berichtszeitraum wurde das Portfolio durch die Rückführung des Engagements in Staatsanleihen und REITs und den Ausbau der EM-Aktienstrategie neu gewichtet.
- Gemäß der am 6. Juni 2023 herausgegebenen Mitteilung an die Anteilhaber begann das Portfoliomanagementteam am 20. Juni 2023 damit, im Vorfeld der Schließung des Portfolios am 6. Juli 2023 Positionen zu veräußern.

*Das Portfolio wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

Next Generation Mobility – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD 1 29,43 %. Der MSCI All-Country World Index (ACWI) (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) rentierte im selben Zeitraum 22,20 %. (Die Performance für alle Anteilsklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die weltweiten Aktienwerte erholten sich im Laufe des Jahres 2023 stark und legten kräftig zu. Die Inflationswerte, die während des größten Teils der Zeit nach COVID erhöht waren, begannen sich im Laufe des Jahres 2023 abzukühlen. Die Renditen stiegen im Laufe des Jahres allgemein an, gaben jedoch gegen Ende des vierten Quartals deutlich nach, da die Straffungszyklen der Federal Reserve (Fed) zu einem Ende kommen und Zinssenkungen möglich sind.
- Vor diesem Hintergrund erzielten wachstumsorientierte Aktien wie die des IT-Sektors und Mega-Cap-Wachstumstitel im Allgemeinen eine Outperformance.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Das Engagement im IT-Sektor lieferte im Berichtszeitraum den größten Positivbeitrag zur relativen Wertentwicklung. Sektoren ohne Allokation wie Basiskonsumgüter, Energie, Gesundheitswesen und Versorger verzeichneten eine Underperformance, was sich auf die relative Performance positiv auswirkte.
 - Geografisch gesehen trug das US-amerikanische Engagement am meisten zur relativen Performance bei.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Das Engagement im Werkstoffsektor schmälerte die relative Wertentwicklung am meisten.
 - Geografisch gesehen war das Engagement in China für die größte Beeinträchtigung der Wertentwicklung verantwortlich.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Während des Berichtszeitraums wurden vier neue Positionen in das Portfolio aufgenommen: Albemarle, LG Energy, BYD und LG Chemical. Zwei Positionen wurden aus dem Portfolio entfernt: Coherent und Chargepoint.

Wir erwarten, dass das makroökonomische Umfeld unbeständig bleiben wird, weil die Zentralbanken versuchen, die Inflation wieder auf das angestrebte Niveau zu bringen und gleichzeitig das Wirtschaftswachstum zu stützen. Obwohl die verzögerten Folgen einer restriktiveren Geldpolitik wahrscheinlich zu einem langsameren Wirtschaftswachstum führen werden, könnte die sich abschwächende Inflation einigen Zentralbanken die Gelegenheit geben, mit Zinssenkungen zu beginnen. Die tragenden Säulen des Themas „Next Generation Mobility“ bleiben unterdessen intakt. Wir rechnen mit weiteren Zuwächsen bei der Markterschließung und solidem Wachstum sowohl bei autonomen als auch bei strombetriebenen Fahrzeugen. Dem liegt neben anderen Faktoren auch die politische Förderung auf regionaler Ebene zugrunde. Wir behalten unseren Fokus auf hochwertigen, fundamental attraktiven Unternehmen bei, die wichtige Wegbereiter und Nutznießer dieses langfristigen Themas sind.

Next Generation Space Economy – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamterrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 27,26 %. Der als Benchmark dienende MSCI All-Country World Index (ACWI) (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) verbuchte im selben Zeitraum ein Plus von 22,20 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamterrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

Als sich das Jahr 2023 seinem Ende zuneigte, zeigte sich die Weltwirtschaft widerstandsfähig, und die Aktienmärkte erlebten ein wiedererstarktes Interesse. Die wichtigsten Indizes erlebten ein Comeback und machten die Rückgänge vom Vorjahr wett. Dabei stand der Technologiesektor im Rampenlicht, wobei KI-zentrierte Unternehmen und Halbleiterwerte die Nase vorn hatten. Dies ging in erster Linie auf den Enthusiasmus der Anleger sowie eine Rally am Telekommunikationsmarkt zurück. Im Gegensatz dazu hatten die traditionelleren defensiven Bereiche des Marktes wie Versorger, Energie und Gesundheitswesen Mühe, das Tempo zu halten, und sie blieben im Verlauf des Jahres zurück.

Die Märkte sahen während des Jahres außerdem erneute und verschärfte geopolitische Spannungen, die sich auf die gesamte Weltwirtschaft auswirkten: Russland/Ukraine, Israel/Hamas und USA/China trugen allesamt dazu bei, die Stimmung der Anleger noch komplexer zu machen. Zusätzlich zu dieser Dynamik rückte die Politik der Zentralbanken in den Mittelpunkt der Aufmerksamkeit, als die Länder sich darum bemühten, die hohe Inflation einzudämmen. Diese Zinserhöhungen führten zunächst zu einem vorsichtigen Ausblick und der Angst vor einer harten Landung. Gegen Ende des Jahres trugen die Erwartung auf bevorstehende Zinssenkungen durch die US-Notenbank und ein mehr abgeschwächtes Arbeitsmarktumfeld dazu bei, dass sich Aktien in den letzten beiden Monaten des Jahres erholten und sich ein positiverer Ausblick für Aktien im Jahr 2024 herauskristallisierte.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Die starke Einzeltitelauswahl im Industriesektor, insbesondere in Luft- und Raumfahrt/Verteidigung.
 - Eine strukturelle Untergewichtung thematisch weniger relevanter Sektoren (z. B. Gesundheitswesen), die während des Jahres einen Rückstand verzeichneten.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Die Einzeltitelauswahl und die Untergewichtung im Sektor Kommunikationsdienste (fehlendes Engagement in Mega-Cap-Technologiewerten wie META Plattformen und Google).
 - Der leichte „Cash-Drag“ durch die opportunistische Verwendung von Kapital nach Zuflüssen aufgrund von Markt-Rallys.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio verfolgte weiterhin einen Hantel-Ansatz zwischen wachstumsorientierten und defensiven Positionen. Wir nutzten wir Verzerrungen als Chance, fundamental und thematisch relevante Positionen einzugehen und hochzuskalieren.
- Eine größere Zahl von Wertpapieren im Portfolio war auf die zunehmenden Multi-Sektor-Anlagegelegenheiten ausgerichtet und trug zur Risikostreuung bei.

Im Jahr 2023 wurden wir Zeuge einer Vielzahl von Fortschritten und Ankündigungen innerhalb des Ökosystems Weltraum, die sich auf eine Vielzahl von Branchen, Unternehmen und Nationen auswirkten. Die Weltraumwirtschaft verzeichnete eine bemerkenswerte Diversifizierung in den Bereich der Telekommunikation hinein. Wir sahen die Einführung von Satelliten-zu-Telefon-Diensten, Versicherungen wie die Swiss-Re, die die Weltraumtechnologie für Risiko- und Wetteranalysen nutzten, und im Bereich der Landwirtschaft kündigte John Deere eine Ausschreibung für Satelliten an, um seine Traktoren weltweit zu vernetzen. Darüber hinaus wurde die Schubkraft des sogenannten „Weltraumwettlaufs 2.0“ deutlich, als Indien im Juli als viertes Land eine Mondlandung bewerkstelligte und in Japan einige neue raumfahrtorientierte Unternehmen an die Börse gingen. Dieser Enthusiasmus ist Beleg für die wachsenden Ertragsströme in diesem Sektor, die durch eine robuste Nachfrage, verbesserte Fähigkeiten und die Ausweitung der Endmärkte angetrieben werden. Unsere Anlagestrategie konzentriert sich weiterhin auf fundamental starke Ideen, die mit dem Thema Raumfahrt verbunden sind. Wir sind zuversichtlich, dass das Portfolio strategisch positioniert ist, um von der erwarteten Expansion zu profitieren.

Responsible Asian Debt – Hard Currency – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD 1 6,45 %. Der als Benchmark dienende JPM Asia Hard Currency Index (Total Return, USD) (der Index) verzeichnete im selben Zeitraum ein Plus von 7,02 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendeneträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Das Jahr 2023 war durch eine hohe Zinsvolatilität gekennzeichnet. Diese war durch die anhaltenden Zinserhöhungen der US-Notenbank, den sich während des Jahres einstellenden Verlusts der wirtschaftlichen Dynamik in China sowie die erhöhte Unsicherheit über den Verlauf des künftigen Wachstums in der gesamten Region bedingt.
- Die Anlageklasse Asia Debt Hard Currency zeigte sich im Laufe des Jahres bei den Fundamentaldaten widerstandsfähig. Technische Faktoren spielten bei der Unterstützung der Anlageklasse ebenfalls eine wichtige Rolle, da die Nettoemissionen in US-Dollar einen historischen Tiefstand erreichten.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Auf Länderebene trugen vor allem Sri Lanka, Indien, Südkorea und Indonesien zu einer positiven relativen Rendite bei.
 - Zu den besten Übergewichtungen, die im Vergleich zum Index einen positiven Wertbeitrag leisteten, gehörten die Sektoren Finanzen, Versorger und Industrie.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Die Performance wurde im Laufe des Jahres vor allem durch die Allokation des Portfolios zu China beeinträchtigt, eine Folge der anhaltenden Volatilität im Hochzins-Immobilienmarkt.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Während des Berichtszeitraums erhöhte das Portfolio sein Engagement unter anderem in Südkorea, Singapur und Sri Lanka.
- Trotz teilweiser Gewinnmitnahmen bei Staatsanleihen aus Sri Lanka behielten wir eine insgesamt übergewichtete Position bei.
- Das Portfolio verringerte im Berichtszeitraum sein Engagement unter anderem in China, Hongkong und Macao.

Mit Blick auf die Zukunft gehen wir davon aus, dass die Schuldtitel der asiatischen Schwellenländer durch ein langsames, aber nicht rezessives US-Wachstum, niedrigere globale Renditen und einen allgemein größeren Wachstumsvorsprung der Schwellenländer gegenüber den Industrieländern unterstützt werden. Die relativ schwache Nachfragerholung in China, Deflationssorgen und der strukturelle Gegenwind für die Wirtschaft werfen weiterhin Fragen auf. Was den Rest der Region angeht, so sehen wir weiterhin eine strukturelle Stärkung der makroökonomischen Fundamentaldaten Indiens und Indonesiens, wie beispielsweise eine robustere Außenhandelsbilanz. Was die Ausfälle angeht, glauben wir, dass sie in Asien außerhalb Chinas niedrig bleiben werden und sich der Schwerpunkt weiterhin auf den Immobiliensektor in Chinas Hochzinssegment konzentrieren wird. Außerhalb Chinas sehen wir vor allem in Süd- und Südostasien, einschließlich Indien, Anlagechancen. Die Fundamentaldaten und Bewertungen sind hier attraktiv, insbesondere im Bereich der erneuerbaren Energien.

Short Duration Emerging Market Debt – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD 18,06 %. Der ICE BofA 3-Month US Treasury Bill Index (Total Return, USD) (der Index) verbuchte während des gleichen Zeitraums 5,01 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die Marktstimmung wurde in erster Linie von Entwicklungen im Zusammenhang mit Inflation und Geldpolitik geprägt. Die Renditen auf 2-jährige US-Staatsanleihen waren sehr volatil und stiegen auf weit über 5 % an, bevor sie im letzten Quartal stark zurückgingen und, inmitten von Anzeichen, dass der Zinserhöhungszyklus der Fed beendet war, das Jahr wenig verändert bei 4,25 % beendeten.
- In Verzug geratenen Schwellenländer erzielten weitere Fortschritte bei den Umstrukturierungsvereinbarungen mit offiziellen und privaten Gläubigern.
- Die Spreads für EM-Staatsanleihen verengten sich im Schnitt von 384 Bp auf 453 Bp mit einem Höchststand von 510 Bp im März etwa zu der Zeit, als in den USA und Europa die Bankenkrise einsetzte. Auch die Spreads von EM-Unternehmensanleihen verengten sich von 273 auf 308 Bp.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Beteiligungen an Staatsanleihen aus El Salvador leisteten aufgrund der guten Haushaltslage den größten Beitrag zur Performance, gefolgt von unseren Staatsanleihen in Sri Lanka, Argentinien und Kolumbien.
 - In Bezug auf Unternehmensanleihen trugen vor allem Positionen in den Sektoren Bergbau und erneuerbare Energien in Indien sowie Beteiligungen in den Sektoren Energie und Banken in Kolumbien bei.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Das Engagement bei Staatsanleihen in Ecuador sorgte für die meisten Abzüge von der Wertentwicklung, da die Anleihen aufgrund der zunehmenden politischen Risiken unter Druck standen.
 - Die Positionierungen bei Unternehmensanleihen im brasilianischen Industriesektor war der andere große Negativfaktor in diesem Zeitraum.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio blieb bei einer ausgewogenen Allokation in EM-Unternehmensanleihen und staatlichen/quasistaatlichen Emissionen und einer Duration von knapp 2 Jahren.
- Wir bauten unser Engagement bei hochwertigen Emittenten aus Südkorea in allen Sektoren über den Primärmarkt ebenso aus wie bei Emittenten mit einem BB-Rating, bei denen wir eine Verbesserung der Fundamentaldaten ihrer Anleihen sehen, darunter Kolumbien und Serbien.
- In China reduzierten wir angesichts der knappen Bewertungen verschiedener Namen und des anhaltenden Gegenwinds für den Immobiliensektor unser Engagement. Ebenfalls reduziert haben wir das Engagement in Katar und Oman, da sich die Spreads verengt haben.

Wir gehen davon aus, dass die Anlageklasse der EM-Anleihen 2024 von einem Umfeld mit einem langsameren aber nicht rezessivem US-Wachstum, niedrigeren globalen Renditen und einem zunehmenden Wachstumsvorsprung für Schwellenländer gegenüber den Industrieländern unterstützt werden wird. Wir sehen ein für dieses Jahr begrenztes Risiko für Ausfälle von EM-Staatsanleihen, und das verstärkte Engagement des Internationalen Währungsfonds (IWF) in verschiedenen Schwellenländern sollte deren Finanzierungsbedarf und die Reformagenda unterstützen. Bei den hochverzinslichen EM-Unternehmensanleihen sehen wir ebenfalls sinkende Ausfallrisiken, wobei erwartet wird, dass die Ausfallraten von 7,8 % im letzten Jahr auf 4,8 % im Jahr 2024 fallen dürften. Während die Bewertungen in Teilen der Anlageklasse, z. B. bei verschiedenen Staatsanleihen mit Investment Grade, relativ teuer geworden sind, sehen wir bei diversen Emittenten weiterhin Gelegenheiten für Spread-Verengungen, insbesondere im Hochzinssegment. Die Hauptrisiken für unsere konstruktive Sichtweise sind entweder eine unerwartete Beschleunigung der Inflationsdynamik weltweit, die deutlich mehr Zinserhöhungen erfordern würde, oder eine tiefe globale Rezession, die die EM-Risikoprämien erheblich in die Höhe treiben würde.

Short Duration High Yield SDG Engagement – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD 19,93 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendeneträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Der Markt für Hochzinsanleihen beendete den Berichtszeitraum mit starken Renditen, die von der Risikobereitschaft gegen Jahresende angetrieben wurden, als die Spreads zurückgingen und die Märkte für 2024 trotz robuster Wirtschaftsdaten Zinssenkungen einpreisten. Für das Kalenderjahr 2023 waren die Renditen von Hochzinsanleihen die höchsten seit 2019.
- Die aggregierten Fundamentaldaten von Hochzinsemitenten in Bezug auf das Wachstum des Gewinns vor Zinsen, Steuern und Abschreibungen, der freie Cashflow, die Zinsdeckung und der Verschuldungsgrad, hielten sich in einem recht günstigen Bereich, und die Ertragssaison fiel im Großen und Ganzen besser aus als befürchtet. Die Aussichten in Bezug auf Zahlungsausfälle bleiben ebenfalls relativ günstig.
- Zwar ist die Ausfallquote von ihren Tiefstständen im Jahr 2022 gestiegen, doch erwarten wir, dass die Ausfallquoten in 2024 in einem Bereich knapp unter dem langfristigen Durchschnitt bleiben werden. Dieser Ausblick stützt sich auf unsere Bottom-up-Beurteilung von Emittenten und wird getragen von dem qualitativ höherwertigen Ratingsmix im Hochzinssegment (48 % der Emittenten mit Kreditratings von BB), von weniger aggressiven Neuemissionen, weniger kurzfristigen Fälligkeiten sowie einem Energiesektor, der deutlich solider ist als in den letzten Zyklen.

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

- Positivbeiträge zur absoluten Rendite:
 - Aus sektoraler Sicht die Positionierungen im Sektor Midstream-Energie, im Werkstoffsektor und bei Kabel/Satelliten.
 - Aus der Perspektive der Ratings die Positionierungen bei Emittenten mit den Ratings B, BB, CCC und BBB.
- Negativbeiträge zur absoluten Rendite:
 - Aus Sektorsicht die Positionierungen in den Bereichen Sonstige Industrie sowie Glücksspiel und Beherbergung.
 - Aus Ratingperspektive gab es keine Wertabzüge.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

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

Wir sind der Meinung, dass die Bewertungen von Hochzinsanleihen eine mehr als angemessene Entschädigung für die mehr oder weniger durchschnittlichen Ausfallerwartungen darstellen, die Anleihen weiterhin dauerhafte Erträge bieten und im Vergleich zu anderen festverzinslichen Alternativen attraktiv sind. Da die Kreditstreuung zugenommen hat, konzentrieren sich unsere Analysten auf die spezifischen Fundamentaldaten individueller Emittenten und bewerten die Basis- und Abwärtsszenarien im Falle einer weichen Landung oder Rezession. Trotz potenzieller kurzfristiger Volatilität, die sich aus der Unsicherheit in Bezug auf das Wirtschaftswachstum ergibt, sind wir der Meinung, dass wir mit unserem fundamentalen Bottom-up-Kreditresearch – mit Konzentration auf die Auswahl von Wertpapieren, die Vermeidung von Bonitätsherabstufungen und die ausschließliche Aufnahme der „besten Ideen“ in die Portfolios – gut aufgestellt sind, um von eventueller Volatilität zu profitieren.

Strategic Income – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD 18,88 %. Der als Benchmark dienende Bloomberg US Aggregate Bond Index (Total Return, USD) (der Index) verbuchte im selben Zeitraum 5,53 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- In dem Bemühen, die Inflation zu bekämpfen, setzten die Zentralbanken der Industrieländer ihren Zinserhöhungszyklus fort. Die Federal Reserve hob die Leitzinsen um 100 Basispunkte (Bp) an.
- Die Zinsvolatilität war während des gesamten Berichtszeitraums hoch. Im November und Dezember, als die Inflation im Griff zu sein schien und eine Verlangsamung des Wachstums erwartet wurde, preiste der Markt zunehmend aggressive Zinssenkungen in der nahen Zukunft ein. Dies trug zu einer erheblichen Rally bei Staatsanleihen und Aktien bei.
- Die Kreditspreads verengten sich im Berichtszeitraum, was auf eine besser als erwartete Wirtschaftsleistung und eine stetige Nachfrage nach Unternehmensanleihen zurückzuführen ist. Die Kreditspreads für US-amerikanische Unternehmensanleihen mit und ohne Investment Grade (IG) verengten sich um 28 Bp bzw. 144 Bp.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Allokationen zu US-amerikanischen und europäischen Hochzinsanleihen, Kreditrisikotransfers von Collateralised Loan Obligations (CLO), Schwellenländeranleihen, inflationsgeschützten US-Staatsanleihen und Kommunalobligationen.
 - Die Einzeltitelauswahl bei globalen IG-Unternehmensanleihen und quasistaatlichen Mortgage Backed Securities (MBS).
 - Die Untergewichtung der Duration im Portfolio.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Die Untergewichtung von IG-Unternehmensanleihen.
 - Die Allokation zu in hybriden Finanztiteln.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Hinsichtlich der Portfolioadjustierung haben wir im Laufe des Jahres das Engagement in US-Hochzinstiteln, nominalen US-Staatsanleihen und IG-Unternehmensanleihen reduziert.
- Wir erhöhten das Engagement bei quasistaatlichen MBS, CLO-Schuldtiteln und europäischen Hochzinsanleihen.
- Auf der Kernebene reduzierten wir die Portfolioduration um etwa eineinhalb Jahre.

Angesichts der sich verbessernden Inflationstendenzen und dem Umstand, dass die Zinssätze der Zentralbanken wahrscheinlich ihren Höchststand erreicht haben, sind wir der Auffassung, dass das wirtschaftliche Wachstum immer wichtiger für die Renditen festverzinslicher Wertpapiere wird. Wir bevorzugen das Halten von festverzinslichen Wertpapieren mit einer Laufzeit von bis zu fünf Jahren, um die noch immer hohen Zinsen zu sichern, bevor sie wieder sinken. Wir erwarten, dass sich die Zerteilung der Kreditmärkte zugunsten von Qualität fortsetzen wird. Insgesamt glauben wir, dass 2024 eine lohnende Zeit für solche globale Anleiheinvestoren sein könnte, die sich beim Aufbau ihrer Portfolios auf Fundamentaldaten und Selektivität konzentrieren.

Sustainable Asia High Yield – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 2,04 %. Der als Benchmark dienende JPMorgan ESG Asia Credit (JSEC JACI) – High Yield Index (Total Return, USD) (der Index) verbuchte im selben Zeitraum 4,07 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Das Jahr 2023 war durch eine hohe Zinsvolatilität gekennzeichnet. Diese war durch die anhaltenden Zinserhöhungen der US-Notenbank, den sich während des Jahres einstellenden Verlusts der wirtschaftlichen Dynamik in China sowie die erhöhte Unsicherheit über den Verlauf des künftigen Wachstums in der gesamten Region bedingt.
- Die asiatischen Märkte für hochverzinsliche Unternehmensanleihen erzielten im Jahresverlauf insgesamt positive Renditen, und viele Sektoren zeigten eine grundsätzliche Widerstandsfähigkeit. Bestimmte Sektoren waren allerdings weiterhin von einer hohen Volatilität geprägt, insbesondere der chinesische Hochzins-Immobilienktor.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Auf Länderebene trugen vor allem Sri Lanka, Macau, Malaysia und Indien zu einer positiven relativen Rendite bei.
 - Zu den wichtigsten Übergewichtungen, die im Vergleich zum Index einen positiven Wertbeitrag leisteten, gehörten die Sektoren Telekommunikation, Metalle & Bergbau sowie Konsumgüter.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Die Performance wurde im Laufe des Jahres vor allem durch die Allokation des Portfolios zu chinesischen Immobilien beeinträchtigt, eine Folge der anhaltenden Volatilität im Hochzins-Immobilienktor.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Während des Berichtszeitraums erhöhte das Portfolio sein Engagement unter anderem in Südkorea, Macau und den Philippinen.
- Das Portfolio verringerte das Engagement u. a. in Hongkong, Singapur und China.

Mit Blick auf die Zukunft gehen wir davon aus, dass die Schuldtitel der asiatischen Schwellenländer durch ein langsames, aber nicht rezessives US-Wachstum, niedrigere globale Renditen und einen allgemein größeren Wachstumsvorsprung der Schwellenländer gegenüber den Industrieländern unterstützt werden. Die relativ schwache Nachfragerholung in China, Deflationssorgen und der strukturelle Gegenwind für die Wirtschaft werfen weiterhin Fragen auf. Was den Rest der Region angeht, so sehen wir weiterhin eine strukturelle Stärkung der makroökonomischen Fundamentaldaten Indiens und Indonesiens, wie beispielsweise eine robustere Außenhandelsbilanz. Was die Ausfälle angeht, glauben wir, dass sie in Asien außerhalb Chinas niedrig bleiben werden und sich der Schwerpunkt weiterhin auf den Immobiliensektor in Chinas Hochzinssegment konzentrieren wird. Außerhalb Chinas sehen wir vor allem in Süd- und Südostasien, einschließlich Indien, Anlagechancen. Die Fundamentaldaten und Bewertungen sind hier attraktiv, insbesondere im Bereich der erneuerbaren Energien.

Sustainable Emerging Market Corporate Debt – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 7,88 %. Der als Benchmark dienende JPMorgan JESG CEMBI Broad Diversified Index (Total Return, USD) (der Index) verbuchte im selben Zeitraum 9,22 %. (Die Performance für alle Anteilsklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die Marktstimmung wurde generell von Entwicklungen im Zusammenhang mit Inflation und Geldpolitik geprägt, da sich die Erwartungen hinsichtlich etwaiger Maßnahmen der US-Notenbank auf Grundlage der wirtschaftlichen Daten von der ersten auf die zweite Jahreshälfte verschoben.
- Die Wiederöffnung Chinas war im Frühjahr ein Thema, das Unterstützung bot. Gleichzeitig machten ausgefallene Titel Fortschritte bei Umschuldungsvereinbarungen mit öffentlichen und privaten Gläubigern.
- Die Spreads für nachhaltige Unternehmensanleihen aus Schwellenländern („EM“) verengten sich von 323 Basispunkten (Bp) auf 284 Bp mit einem Höchststand von 386 Bp im März. Die Ukraine war im Berichtszeitraum der Markt mit der besten Performance, gefolgt von Irak und Ghana. Am anderen Ende der Skala schnitten Polen und China mit negativen Renditen am schlechtesten ab.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Die Übergewichtung von Argentinien nach den Präsidentschaftswahlen und die Einzeltitelauswahl bei saudi-arabischen Versorgern.
 - Die Übergewichtung von indischen Unternehmen im Bereich der erneuerbaren Energien.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Die Übergewichtung des Engagements in China, das im Laufe des Jahres aufgrund des sich verlangsamenden Wachstums und der anhaltenden Schwäche des Immobilienmarktes eine Underperformance verbuchte.
 - Die Untergewichtung in der Ukraine, wo es im Unternehmensbereich einige Verbesserungen gab.
 - Die Positionierungen bei brasilianischen Chemieunternehmen.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Wir begannen das Jahr mit einer Übergewichtung von Hochzins-Unternehmensanleihen. Im Laufe des Jahres verringerten wir unser Engagement im Bereich der BB-Ratings und stockten unseren Korb mit AA-Papieren auf.
- Nach Sektoren aufgeschlüsselt, erhöhten wir unser Engagement bei Emittenten aus dem Bereich Öl & Gas. Wir waren außerdem im Finanzsektor aktiv und beendeten das Jahr hier mit einer höheren Gesamtgewichtung. Wir verringerten unser Engagement im Sektor Metalle & Bergbau, da die Preise hier und insbesondere für Eisenerz allgemein zurückgingen. Wir verringerten zudem unser Engagement im Telekommunikationssektor, wo einige Emittenten unter Druck gerieten.
- Nach Ländern aufgeschlüsselt erhöhten wir unser Engagement in der Türkei, da die geldpolitischen Entscheidungsträger zu einer mehr orthodoxen Politik zurückkehrten, in den Vereinigten Arabischen Emiraten, wo Neuemissionen attraktive Prämien boten und wir den Ausblick für den Finanzsektor als positiv einschätzten, und in Argentinien, wo eine neue Regierung die Emittenten von Unternehmensanleihen unterstützt. Wir reduzierten unser Engagement in Südafrika, Katar, China und Brasilien.

Wir gehen davon aus, dass die Anlageklasse der EM-Anleihen in 2024 von einem Umfeld mit einem langsameren, aber nicht rezessiven US-Wachstum, niedrigeren globaler Renditen und einem zunehmenden Wachstumsvorsprung für Schwellenländer gegenüber den Industrieländern unterstützt werden wird. Wir sehen ein für dieses Jahr begrenztes Risiko für Ausfälle von EM-Staatsanleihen, und das verstärkte Engagement verschiedener Schwellenländer mit dem Internationalen Währungsfonds (IWF) dürfte den Finanzierungsbedarf und die Reformpläne unterstützen. Während die Bewertungen in Teilen der Anlageklasse, z. B. im Investment-Grade-Bereich, relativ teuer geworden sind, sehen wir bei diversen Emittenten weiterhin Gelegenheiten für Spread-Verengungen. Die Hauptrisiken für unsere konstruktive Sichtweise sind entweder eine unerwartete Beschleunigung der Inflationsdynamik weltweit, die deutlich mehr Zinserhöhungen erfordern würde, oder eine tiefe globale Rezession, die die EM-Risikoprämien erheblich in die Höhe treiben würde.

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 13,11 %. Der als Benchmark dienende JPMorgan ESG EMBI Global Diversified Index (Total Return, USD) (der Index) verbuchte im selben Zeitraum 10,26 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendeneträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Das Jahr begann für die Schwellenländer positiv, da davon ausgegangen wurde, dass eine sanfte Landung und eine damit einhergehende Lockerung der Geldpolitik in den USA der Anlageklasse durch niedrigere Kreditkosten zugute kommen würde. Die Risikostimmung verschlechterte sich, als der Zusammenbruch der Silicon Valley Bank im März zu einigen der seit Jahrzehnten größten Bewegungen am Rentenmarkt führte.
- Ab dem Sommer führte dann die Aussicht auf für einen längeren Zeitraum höhere Zinsen zu einem großen Ausverkauf bei Anleihen, der die Renditen auf 10-jährige US-Staatsanleihen zum ersten Mal seit der globalen Finanzkrise kurzzeitig über 5 % klettern ließ. Der Markt begann ab Oktober erneut damit, das Szenario einer weichen Landung einzupreisen, und das Thema gewann im Dezember weiter an Dynamik, insbesondere nachdem die Fed eine Zinssenkung um 75 Basispunkte (Bp) für 2024 angekündigt hatte.
- Die geopolitischen Ereignisse blieben ebenfalls im Fokus, insbesondere nach dem Angriff der Hamas auf Israel im Oktober, während es unterdessen keine Lösung für den Krieg in der Ukraine gab.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Die Länderallokation zeichnet sich durch die Übergewichtung von Märkten mit höheren Renditen aus, insbesondere El Salvador, Argentinien und Sri Lanka. Sie erfüllen die ökologischen oder sozialen Ziele des Portfolios.
 - Die Einzeltitelwahl über auf Euro lautende Anleihen Rumänien und Serbien.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Eine übergewichtete Allokation zu Ecuador, wo politische Herausforderungen den Druck auf die Finanzen verstärkten.
 - Die Untergewichtung der Türkei, wo die Regierung eine deutliche Kehrtwende vollzog und einer orthodoxen Politik zu folgen begann.
 - Die Einzeltitelwahl in Ghana über die partielle Weltbankgarantie bis 2030.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio änderte seinen Rahmen für nachhaltige Staatsanleihen, indem es Messungen der biologischen Vielfalt und der Einkommensungleichheit sowie zusätzliche Gesundheitsindikatoren einbezog. Es ist das Ziel des Portfolios, 100 % seines Engagements bei Anleihen in nachhaltigen Anlagen zu halten.
- Das Portfolio hielt an einer Tendenz zu Hochzinstiteln (gegenüber Unternehmensanleihen mit Investment Grade) fest. Wir erhöhten unsere Übergewichtung von Argentinien in Erwartung positiver politischer Anpassungen nach den Wahlen sowie ebenso in Armenien, Kolumbien, El Salvador, und Serbien, wo wir eine Widerstandsfähigkeit gegenüber den strengeren globalen Finanzierungsbedingungen feststellen.
- Wir stockten unsere Übergewichtung in Polen auf und verkauften aufgrund geänderter Nachhaltigkeitsbewertungen Staatsanleihen aus Ecuador, Panama und den Vereinigten Arabischen Emiraten.

Wir gehen davon aus, dass die Anlageklasse der EM-Anleihen von einem Umfeld mit einem langsameren aber nicht rezessivem US-Wachstum, niedrigeren globalen Renditen und einem zunehmenden Wachstumsvorsprung für Schwellenländer gegenüber den Industrieländern im Jahr 2024 unterstützt werden wird. Wir sehen ein für dieses Jahr begrenztes Risiko für Ausfälle von Staatsanleihen, während das verstärkte Engagement des Internationalen Währungsfonds (IWF) in verschiedenen Schwellenländern den Finanzierungsbedarf und die Reformagenda unterstützen dürfte. Die technischen Daten der Anlageklasse haben sich verbessert, da die Anleger nach einer Periode mit Rekordabflüssen hier nur noch geringfügig positioniert und die Zahl der Nettoemissionen begrenzt sind. Wir sehen Chancen für eine Verengung der Spreads bei bestimmten Emittenten und Anleihen von außerhalb der Benchmark, insbesondere im BB-Ratingsegment.

Tactical Macro – Berichts des Investment-Managers

Für den Berichtszeitraum von seiner Auflegung am 30. Juni 2023 bis zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 2,20 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse.

- Globale Aktien und Anleihen verbuchten im Jahr 2023 eine starke Performance und trotzten damit den Erwartungen der meisten Anleger, die erwartet hatten, dass der globale Straffungszyklus die Wirtschaftstätigkeit belasten würde.
- Der Inflationsdruck ließ im Jahresverlauf nach, und die Zentralbanken gingen von einer aggressiven Rhetorik zu einer datenabhängigen Haltung über und stellten zum Jahresende die Weichen für Zinssenkungen im Jahr 2024.
- Während die Anleger durch ein unbeständiges, von regionalem Bankenstress sowie geopolitischen und politischen Spannungen geprägten Wirtschafts- und Investitionsumfeld navigierten, blieben die Unternehmensgewinne dank eines gut gestützten Verbraucher- und Arbeitsmarktes stabil.

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

- Positivbeiträge zur absoluten Rendite:
 - Der Gesamtertrag des Portfolios ohne Barmittel bestand während des Berichtszeitraums aus S&P 500-Kaufoptionen, Short-Positionen bei 10-jährigen US-Staatsanleihen und eine Short-Position des Russell 2000.
- Negativbeiträge zur absoluten Rendite:
 - Short-Positionen bei japanische Staatsanleihen, eine Short-USD/JPY -Position und S&P-500-Risikoumkehrpositionen.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Im dritten Quartal 2023 begannen wir damit, das Portfolio so zu positionieren, dass es durch sein Engagement entlang der Renditekurve und eine Short-Position bei US-Aktien eine Stagflationsperspektive in seiner Konstruktion einbettet. Zudem haben wir Long-Positionen im Euro und im japanischen Yen implementiert.
- Im vierten Quartal 2023 verlagerte sich unser Schwerpunkt vom Handel mit Qualitätsaktien auf einen breiter angelegten Ansatz. Aufgrund der veränderten Signale der Fed kam es bei Positionen mit Schwerpunkt auf Small-Caps und Aktien mit einer kurzen Duration zu einer Umkehr.
- Als wir uns dem Ende des Jahres 2023 näherten und sich ein zuversichtlicheres Marktszenario für eine weiche Landung einstellte, profitierte das Portfolio von einem kurzlaufenden SPX-Call. Außerdem implementierten wir Call-Spreads auf die Secured Overnight Financing Rate (SOFR), da wir der Ansicht waren, dass der Markt in seiner Preisgestaltung für den Zeitpunkt und das Ausmaß von Zinssenkungen zu präventiv geworden war.

Mit Blick auf die Zukunft sind wir der Ansicht, dass der einzigartige Charakter dieses geldpolitischen Straffungszyklus Risikoanlagen unterstützt hat, doch müssen wir uns auch nach dem Ausstieg aus dem Straffungszyklus der großen Bandbreite der Ergebnisse bewusst sein, die sich im Jahr 2024 ergeben könnten. In unseren Augen ist es höchst ungewöhnlich, dass ein rascher Rückgang des nominalen BIP ohne eine gewisse Beeinträchtigung der Gewinnspannen und Erträge erfolgt. Dennoch sind die Konsensusprognosen für Aktienwerte in den letzten Monaten kontinuierlich gestiegen. Außerdem gibt es Zeiten, in denen es am Markt um Dynamik und Kapitalströme geht, und Zeiten, in denen man sehr genau darauf achten muss, was bereits eingepreist ist: Während eine auf Liquidität basierende Rally von hier aus durchaus möglich ist (sogar eine aggressive Rally), falls der Markt wirklich einen sich abzeichnenden Lockerungszyklus annimmt, haben wir bereits die größte Divergenz der Wahrscheinlichkeiten für eine weiche Landung – im Vergleich zu dem Stagflationsszenario seit Ende 2021 – eingepreist. In Anbetracht der Ausgangslage zu Beginn des Jahres werden wir ein gewisses Short-Engagement bei US-Aktien gegenüber japanischen Aktien sowie Long-Positionen in fünfjährigen US-Staatsanleihen aufbauen. Letztere wollen wir im Falle eines Renditeanstiegs im Zusammenhang mit der Sorge des Marktes über das Angebot von Neuemissionen aufstocken. Auch haben wir unsere Long-Position im JPY beibehalten. Wir sind nach wie vor der Meinung, dass der Markt recht unbeständig ist und dass die Wachstumsaussichten nach wie vor viel unsicherer sind als die Inflationsaussichten. Es wird interessant sein, zu sehen, wie sich dies bis 2024 auf Risikoanlagen auswirkt.

Ultra Short Term Euro Bond – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse EUR I 6,72 %. Der ICE BofA 0-1 Year AAA Euro Government Index (Total Return, EUR) (der Index) verzeichnete im selben Zeitraum 2,46 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividenden und sonstigen Ausschüttungen.)

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Eine volatile Inflation, robuste Wirtschaftsdaten und die Rhetorik der Zentralbanken erwiesen sich im Jahr 2023 als die wichtigsten Antriebskräfte für die Märkte für festverzinsliche Wertpapiere. Die Finanzbedingungen haben sich über weite Strecken des Jahres verschärft, was zu einem Teil eine Folge der Bankenzusammenbrüche im ersten Quartal war, während der Mangel an Arbeitskräften unterdessen die Arbeitsmärkte angespannt hielt und die Verbraucherausgaben über den Erwartungen lagen. Im vierten Quartal änderte sich der Ton, wobei die unter den Erwartungen liegenden Inflationsdaten den Anlegern das Signal gaben, dass die Zentralbanken, einschließlich der Europäischen Zentralbank (EZB), nahe am oder auf dem Höchststand der Zinssätze waren. In Europa schlossen die Investment-Grade- und die Hochzinismärkte mit einer Rendite von 8,84 % bzw. 12,81 % im positiven Bereich.
- Die Zinsmärkte waren in 2023 die Hauptquelle für die Volatilität der Rentenmärkte. Während das Jahr 2023 viele Phasen mit Volatilität aufwies (insbesondere im März und Oktober), wurden im letzten Quartal zahlreiche Inflationsziele verfehlt. Dies führte zu einer Rally an den Zinsmärkten, wo die Renditen zum Jahresende ungefähr auf demselben Niveau lagen wie zu Beginn des Jahres. Die wichtigsten Indizes verzeichneten die besten zwei Monate ihrer Geschichte, darunter der EUR Aggregate (6,14 %) und der Pan-European Aggregate (6,63 %).
- Die Spreads, von denen eine deutliche Ausweitung erwartet wurde, waren stabil (und verengten sich sogar), und die Ausfallraten blieben unter bzw. nahe dem historischen Durchschnitt.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Das Engagement bei Finanz- und Industrierwerten (316 Bp bzw. 260 Bp).
 - Das Engagement bei zyklischen Konsumgütern nahm deutlich zu (70 Bp), da die Performance von Unternehmensanleihen im Jahr 2023 über den Erwartungen lag und die Fundamentaldaten intakt geblieben sind.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Der Einsatz von Derivaten (-52 Bp), die im Jahresverlauf eine dynamische Positionierung ermöglichten und zum Risikomanagement eingesetzt wurden, wirkte sich negativ aus.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Im Laufe des Jahres 2023 haben wir mehrere Handelsstrategien rückgängig gemacht, die wir im Jahr 2022 umgesetzt hatten. Dabei handelte es sich insbesondere um solche, bei denen wir das Kreditrisiko als Reaktion auf die erhebliche Spread-Ausweitung im dritten Quartal des Jahres erhöht hatten. Wir verringerten das Beta des Gesamtportfolios strategisch, indem wir in erster Linie unser Gewichtung von Unternehmensanleihen sowohl im Investment-Grade-Bereich als auch im Hochzinssegment reduzierten. Gleichzeitig profitierten wir von der inversen Renditekurve, indem wir mehr Mittel in gedeckte Anleihen mit kurzer Duration investierten.
- Im Hochzinssegment trennten wir uns von den in unseren Augen überbewerteten Wertpapieren mit einem BB-Rating und stockten unsere Investitionen in REITs auf, um die in den Jahren 2022 und 2023 zu beobachtende erhebliche Spread-Ausweitung zu nutzen.

Zu Beginn des neuen Jahres sind wir in Anbetracht der unsicheren Wirtschaftsaussichten und des Risiko-/Ertragsprofils bei Spreads defensiv positioniert. Die Inflation hat zwar ihren Höhepunkt erreicht, doch werden die Daten im Laufe des Jahres zusammen mit der Gesundheitslage der breiteren europäischen Wirtschaft ausschlaggebend dafür sein, wie schnell die EZB die Zinsen senken kann. Insgesamt liegen die Renditen nach wie vor deutlich über den historischen Durchschnittswerten und wir denken, dass in dieser Anlageklasse immer noch Spielraum für hohe Renditen im Jahr 2024 besteht. Angesichts der Wahlen in den USA, Großbritannien und Europa sowie der anhaltenden geopolitischen Spannungen wird die Volatilität im Jahresverlauf wahrscheinlich zu verschiedenen Zeitpunkten zunehmen. In diesen Phasen werden wir versuchen, dies zu unserem Vorteil zu nutzen und das Portfolio zur Erzielung überdurchschnittlicher Gesamrenditen proaktiv positionieren.

Uncorrelated Strategies – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamterrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I -8,86 %. Der als Benchmark dienende Index, der ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return, USD) (der Index), rentierte im selben Zeitraum 5,12 %. (Die Performance für alle Anteilsklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamterrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- 2023 war ein starkes Jahr für Risikoanlagen, vor allem für US-amerikanische Large-Cap-Aktien, und das trotz der Zinsen (jetzt mehr als 5 % über den jüngsten Tiefständen), des Zusammenbruchs einer Reihe von Banken in den USA und Europa sowie der anhaltenden Konflikte in der Ukraine und im Nahen Osten. Im letzten Quartal des Jahres haben die Märkte eine nachlassenden Inflation, eine Senkung der Zinssätze und eine wohl weiche Landung in den USA, was durch die freundlichen Äußerungen der US-Notenbank im vierten Quartal unterstützt wurde, eingepreist.
- Der MSCI World Index (netto) erzielte im Berichtszeitraum eine Rendite von 23,8 %, und der Bloomberg Global Aggregate Index (USD) kam auf ein Plus von 7,15 %. Währungen bewegten sich im Jahresverlauf innerhalb einer größeren Bandbreite, wobei der US-Dollar (gemessen am US Dollar Index) mit -2,1 % abschloss.
- Wir sehen 2023 aus mehreren Gründen als ein anomales Jahr an. Erstens gab es einige Phasen, in denen die Volatilität von festverzinslichen Wertpapieren so hoch war wie seit über 20 Jahren nicht mehr, während bei Aktien die Lage ruhig blieb. Ein Beispiel wäre der März (mehr als die Hälfte des Jahresverlustes), als wir bei den extremen Kursbewegungen festverzinslicher Wertpapiere auf der falschen Seite standen (nachdem wir im Vorjahr auf der richtigen Seite waren) und für unsere volatilitätsfreundliche Positionierung nicht belohnt wurden, weil die Aktienmärkte ruhig blieben. So legte der S&P 500 vor dem Hintergrund von drei Bankenzusammenbrüchen und der Notrettung einer der ältesten Investmentbanken der Welt um 3,5 % zu.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Versicherungsgebundene Wertpapiere (1,17 %).
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Global Macro (-3,52 %), Trend Following (-1,94 %), Equity Market Neutral (-1,87 %), Short Term Trading (-1,64 %), Statistical Arbitrage (-0,70 %), Volatility Relative Value (-0,58 %)

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Risiko innerhalb der Allokation zu Statistical Arbitrage wurde im Dezember wieder hochgefahren.
- Darüber hinaus nahmen die Unterberater eine weitere Allokation in Statistical Arbitrage vor und begannen im Dezember, ihren Bestand aufzustocken.
- Bei einem anderen Unterberater haben wir die bestehende kurzfristige Gemini-Futures-Handelsstrategie zu dessen Advanced Trend Strategy hinzugefügt, um ein zweites hochwertiges Trendfolge-Standbein zu haben und von den zusätzlichen Vorteilen eines potenziellen Netting von Signalen und einer Reduzierung der Transaktionskosten zu profitieren.
- Schließlich kam es noch im November und Dezember zu einer Rücknahme im Rahmen der Allokation zu Equity Market Neutral.

Bei dieser Strategie beobachten wir historische Höchstrenditen in manchen der turbulentesten Phasen für risikoreichere Anlagen und 60/40-Portfolios. Das Engagement ist aktuell recht breit diversifiziert. Stresstests weisen allgemein auf positive Endergebnisse hin. In unseren Augen passt nicht, dass die Bewertungen von Aktien nach einer Erhöhung der Zinsen in der größten Volkswirtschaft der Welt um 500 Basispunkte nicht heftiger reagieren und das Volatilitätsniveau für gelassenes Vertrauen in die Fähigkeit der Zentralbanken spricht, uns durch einen „kurzfristigen“ Inflationsschub zu einer sanften Landung mit minimalen wirtschaftlichen Problemen zu führen. Angesichts der Tatsache, dass Aktien das Jahr mit einem Plus von mehr als 20 % abschlossen und der Cboe Volatility Index (VIX) neue Tiefstände erreicht hatte, scheint es mehr denn je angemessen, sich nach Alternativen umzusehen, die eine echte Diversifizierung bieten. Letztlich sei erwähnt, dass wir von den neuen Ideen begeistert sind, die wir in der zweiten Jahreshälfte in das Portfolio aufgenommen haben. Wir hoffen, in den kommenden Monaten die Vorteile davon zu sehen.

Uncorrelated Trading* – Berichts des Investment-Managers

Für den Zeitraum vom 1. Januar 2023 bis zur Schließung des Portfolios am 24. Mai 2023 betrug die Gesamrendite für die thesaurierende Klasse USD X - 2,40 %. Der ICE BofA US Dollar 1-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return, USD) (der Index) rentierte im selben Zeitraum 1,82 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die ersten vier Monate des Jahres waren fraglos eine schwierige Phase für das Portfolio. Daran schloss sich eine ruhigere Periode mit neutraler Ertragsentwicklung an, wobei angesichts einer kräftigen Risiko-Rally auf Schutz in Abwärtsrichtung geachtet wurde.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Der Berichtszeitraum bot für unsere sechs Kernallokationen aus ganz verschiedenen Gründen ausnahmslos ein schwieriges Handelsumfeld. Das Jahr begann im Januar mit Verlusten, gefolgt von einem leichten Plus im Februar, bevor die Schaukelmärkte vom März dem Portfolio ein Abwärtsquartal bescherten. Das zweite Quartal verlief aus Wertentwicklungssicht verhaltener. Im April stand ein Minus zu Buche, bevor das Portfolio im Verlauf des Monats Mai einen vollständigen Risikoabbau durchführte.
- Für das erste Quartal wies das Portfolio ein Minus von 1,90 % aus. Für das negative Quartalsergebnis war dabei überwiegend die Wertentwicklung im Januar verantwortlich. Nach Strategien leistete unsere Allokation im Segment Equity Market Neutral einen positiven Beitrag, Short Term Trading, Volatility Relative Value und Statistical Arbitrage dagegen einen negativen. Im Quartal gaben alle Anlageklassen nach, angeführt von festverzinslichen Wertpapieren und gefolgt von Devisen- und Aktiengeschäften.
- Für das zweite Quartal wies das Portfolio ein Minus von 0,51 % aus, mit Verlusten im April und Mai. Nach Strategien leistete unsere Allokation im Segment Short Term Trading einen neutralen Wertbeitrag, Equity Market Neutral, Volatility Relative Value und Statistical Arbitrage dagegen einen negativen. Nach Anlageklassen wirkten sich Geschäfte mit Unternehmensanleihen und Zinssätzen positiv aus, solche mit Aktien und Devisen negativ.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Die Allokationen in Unterberater blieben im Berichtszeitraum unverändert.

* Das Portfolio wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

US Equity – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtertragsrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD 136,82 %. Der als Benchmark dienende S&P 500 Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) verzeichnete im selben Zeitraum ein Plus von 25,67 %. (Die Performance für alle Anteilsklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtertragsrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividenderträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Das Wirtschaftsklima wurde im Verlauf des Jahres von einer Vielzahl von Faktoren geprägt, dabei u. a. Zinserhöhungen der Federal Reserve in der ersten Jahreshälfte gefolgt von einer Pause des Zinserhöhungszyklus in der zweiten Jahreshälfte.
- Trotz des verhaltenen Konjunkturausblicks legten die Märkte weiter kräftig zu, obwohl die Gewinne im S&P 500 insgesamt leicht nachgaben, was darauf zurückzuführen war, dass erhöhte Kosten auf die Margen drückten.
- Währenddessen sorgten durchwachsene Wirtschaftsdaten weiter für Volatilität auf dem Markt. Die stärksten Schwankungen betrafen die Renditekurven kurz laufender Staatsanleihen. Das rasante Zinserhöhungstempo löste auch Aktiv-Passiv-Inkongruenzen bei mehreren US-amerikanischen Regionalbanken aus, was die Sorgen um die gesamtwirtschaftliche Stabilität noch verstärkte.
- Trotz dieser Herausforderungen sorgten Zuversicht im Zusammenhang mit Fortschritten in der KI sowie ermutigende Gewinnmeldungen von Unternehmen, vor allem von Technologieriesen aus dem Mega-Cap-Segment, zumindest vorübergehend für eine gewisse Erleichterung.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Die Einzeltitelauswahl war in den Sektoren Kommunikationsdienste und IT am positivsten.
 - Die Übergewichtung des Portfolios im IT-Sektor und seine Untergewichtung in Energiewerten steigerte den Ertrag aus Allokationsperspektive am meisten.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Die Einzeltitelauswahl in den Sektoren Nicht-Basiskonsumgüter und Versorger war nachteilig.
 - Aus Allokationssicht wirkte eine Übergewichtung der Barposition ertragsmindernd.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Am stärksten übergewichtet blieb das Portfolio in IT-Werten, am stärksten untergewichtet im Energiesektor. Das war auf unternehmensspezifische Faktoren zurückzuführen, wobei bei den Portfoliorisikofaktoren allgemein auf Ausgewogenheit geachtet wurde.
- Die Barposition des Portfolios verringerte sich im Berichtszeitraum infolge attraktiver Bewertungen und höherer Rentabilität in bestimmten Teilssegmenten des Marktes.

Gegen Ende des Jahres 2023 hat sich gezeigt, dass sich die Wirtschaft zwar verlangsamte, aber widerstandsfähiger war als von vielen erwartet. Anfang Januar lag die Konsensusprognose für eine Rezession bei einer Wahrscheinlichkeit von 2 zu 3, doch wird das BIP-Wachstum in den USA zum Jahresende auf sehr ansehnliche 2,5 % geschätzt. Des Weiteren haben sich die Gewinnsschätzungen für den Index trotz der Forderungen nach einer stärkeren Senkung der Gewinne für das Gesamtjahr gehalten. Der Fokus liegt nun auf 2024. Zur selben Zeit hat die Fed Fortschritte im Kampf gegen die Inflation erzielt, und die Unternehmensgewinne liegen im Durchschnitt über den Erwartungen. Dessen ungeachtet sind die Kommentare zu den nachlassenden Konsumtrends, den anhaltenden Rückgängen bei den Verkäufen bestehender Häuser und den ersten Anzeichen eines nachgebenden Arbeitsmarktes ein deutlicher Hinweis darauf, dass der Straffungszyklus der Fed reale Auswirkungen auf die Gesamtwirtschaft hat. Trotzdem hat die Fed an ihrer Verpflichtung zur Bekämpfung der Inflation festgehalten. Diese hat sich zwar weiter verlangsamt, bleibt aber in bestimmten Kernbereichen wie Lebensmittel, Löhne und Wohnimmobilien hartnäckig, wobei die unerwartet guten Wirtschaftsdaten diese Idee unterstützen. Zwar haben Offizielle der Fed nun angedeutet, dass die Zinssätze wahrscheinlich ihren Höchststand erreicht haben, doch bleibt die Ungewissheit bestehen, wie lange die Zinsen auf diesem hohen Niveau bleiben werden, da die Anleger bereits schon im März mit Zinssenkungen rechnen. Bis wir mehr Klarheit über die Entwicklung der Wirtschaft und der Inflation haben und wie sich dies in tatsächlichen Zinssenkungen gegenüber den Erwartungen niederschlägt, rechnen wir mit einer anhaltenden Marktvolatilität. Im aktuellen Umfeld dürfte sich unseres Erachtens daher im weiteren Verlauf immer klarer abzeichnen, dass sich die operative Leistung der zugrunde liegenden Unternehmen auseinanderentwickelt. Wie immer setzen wir unsere Anstrengungen zum bestmöglichen Verständnis unternehmens- und portfoliospezifischer Faktoren fort, da dieses Umfeld unseres Erachtens vom Zusammenwirken einer Vielzahl von Faktoren wie fiskalpolitische Überlegungen, geldpolitische Anreize, Sorgen um die öffentliche Gesundheit, geopolitische Unsicherheit, Rohstoffpreisvolatilität und Inflationsdynamik geprägt ist. Bei Veränderungen der Marktdynamik kann dies zu einer Verzerrung des Marktwerts von Unternehmen gegenüber ihrem langfristigen potenziellen Wert führen, was für ein volatiles Umfeld sorgt, das potenzielle Gelegenheiten eröffnet.

US Equity Index PutWrite – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 15,39 %. In demselben Zeitraum verzeichnete die zu je 50 % aus dem Cboe S&P 500 One-Week PutWrite Index und dem Cboe S&P 500 PutWrite Index (zusammen der Index) zusammengesetzte Benchmark 11,69 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Trotz zahlreicher Konflikte, des Zusammenbruchs der Silicon Valley Bank, der rasanten Preisinflation, Einwanderung, politischer Kontroversen, Streiks der Gewerkschaften und haushaltspolitischer Unwägbarkeiten schloss der S&P 500 Index das Jahr 2023 mit einer jährlichen Gesamrendite von 25,67 % ab.
- Angesichts der positiven Dynamik am Aktienmarkt und der Erwartung, dass die Federal Reserve im Jahr 2024 einen Zinssenkungszyklus beginnen wird, ging die implizite Volatilität zum Jahresende zurück. Der Cboe S&P 500 Volatilitätsindex (VIX) lag im Jahresdurchschnitt bei 16,9 und damit deutlich unter seinem Durchschnitt von 25,6 für das Jahr 2022, obgleich nur wenige Punkte von seinem langfristigen Durchschnitt entfernt. Der Optionsmarkt für den S&P 500 Index setzte seine positive Entwicklung bzgl. der impliziten Volatilitätsprämie mit einer durchschnittlichen Prämie von 4,3 im Jahr 2023 fort.
- Viele alternative Strategien schnitten im Vergleich zu ihrer jüngeren Vergangenheit – gekennzeichnet durch Nullzinsen und volatile Aktienmärkte, die das Renditepotenzial schmälerten – gut ab. Insgesamt legten Aktienindex-Putwriting-Strategien im Vergleich zu gängigen Anlagestrategien eine gute Performance vor, und unserer weniger direktionalen Indexoptionsstrategie gelang es, durch die Umkehr der Performance des S&P 500 von August bis Dezember zu navigieren. Wir denken, dass sich diese Trends fortsetzen könnten, wenn die wirtschaftliche und politische Unsicherheit in den USA die Renditen an den Aktien- und Kreditmärkten abkühlt und sich die Marktunsicherheit im neuen Jahr verflüchtigt und von den jüngsten Tiefstständen erholt.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Auf Jahressicht erzielte das Optionssegment des S&P 500 eine beachtliche Rendite von 15,50 % und übertraf die Rendite des Cboe S&P 500 PutWrite Index von 14,32 %. Im selben Zeitraum blieb der Cboe S&P 500 One-Week PutWrite Index mit einer Rendite von 9,07 % deutlich zurück. Parallel dazu gewann das Sicherheitenportfolio im bisherigen Jahresverlauf 4,39 % dazu, während sich der Ertrag des ICE BofA 0-3 Month US T-Bill Index auf 5,01 % belief.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Die relativen Renditen wurden während des Berichtszeitraums durch keinerlei Beteiligungen beeinträchtigt.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

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

Wir glauben nicht, dass die wirtschaftliche Rezession, die für 2023 „so sicher“ war, in der ersten Hälfte von 2024 wahrscheinlicher wird. Unsere einfache Hypothese lautet: Die höheren Portfolioerträge, die den Anlegern in Form von Zinszahlungen zugute kommen, werden auch weiterhin eine kurzfristige Einkommensverbesserung für die große amerikanische obere Mittelschicht darstellen. Der direkte wirtschaftliche Stimulus, der den Verbrauchern und Vermögensbesitzern von der Federal Reserve gegeben wurde, hat sich nun auf die Vergabe von Zinszahlungen (Cashflows) durch das US-Finanzministerium an die Inhaber von Schuldtiteln verlagert. Bei Letzteren handelt es sich meist um wohlhabende Anleger und Institutionen. Der unmittelbare Einkommenszuwachs für Unternehmen, die Ausgaben tätigen, wird nicht sofort durch den Anstieg der längerfristigen Finanzierungskosten ausgeglichen, die auf Anleger und Unternehmen in den kommenden Jahren zukommen werden. Wir glauben daher nicht, dass die Fed die „Handbremse“ für die Wirtschaft ziehen muss, denn die „weiche Landung“ ist bereits im Gange. Wir sind allerdings mit Blick auf die ersten Quartale 2024 der Meinung, dass die Aussichten für Aktien sehr viel unklarer werden könnten. Hinzu kommt eine konfliktbehaftete Präsidentschaftswahl in den Vereinigten Staaten im November, wodurch 2024 ein Jahr mit einer relativ hohen Volatilität sein könnte.

US Large Cap Value – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I -2,63 %. Der als Benchmark dienende Russell 1000 Value Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) verzeichnete im selben Zeitraum ein Plus von 10,68 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividenden erträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Der Markt setzte im Laufe des Jahres gegen mehrere Gegenwinde durch, darunter eine erhöhte Inflation, Zinserhöhungen der Federal Reserve, die Sorge, dass die Wirtschaft in eine Rezession abgleiten könnte, eine Mini-Krise im regionalen Bankensektor und zahlreiche geopolitische Ereignisse. Trotz alledem wuchs die Wirtschaft weiter und die Unternehmensergebnisse übertrafen oftmals die Erwartungen.
- Die Anlegerstimmung verbesserte sich gegen Ende des Jahres, als die Fed eine Kehrtwende vollzog, indem sie das wahrscheinliche Ende der Zinserhöhungen und das Potenzial für Zinssenkungen im Jahr 2023 andeute.
- Im Laufe des Jahres wurde der Markt von Mega-Caps im Technologiebereich und Unternehmen, die sich mit KI beschäftigen, angeführt.
- Alles in allem brachte der S&P 500 Index im Berichtszeitraum mit 25,67 % eine höhere Rendite als der Index, der 10,68 % verbuchte.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Die Einzeltitelauswahl im Basiskonsumgütersektor (angeführt von Nahrungsmitteln).
 - Was die Einzeltitel angeht, so war Oracle Corp. übergewichtet und Walt Disney Company sowie CVS Health Corp. waren untergewichtet.
 - Aus Sicht der Sektorpositionierung waren Energie unter- und Werkstoffe übergewichtet.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Für die meisten Wertabzüge verantwortlich zeichneten in puncto Sektorallokation eine Untergewichtung von Kommunikationsdiensten, eine Übergewichtung von Versorgern und eine Untergewichtung von IT.
 - Die Einzeltitelauswahl unter Industriewerten (vor allem Maschinen), im Gesundheitswesen (vor allem Geräte und Zubehör) und Werkstoffe (vor allem Metalle und Bergbau).
 - Zu nennenswerten Positionierungen bei Einzeltiteln gehörten eine Nullgewichtung von Meta Platforms, Inc. Klasse A, zusammen mit Übergewichtungen von Exelon Corp. und Pfizer, Inc.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

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

Wir schätzen auch weiterhin die Auswirkungen einer Konjunkturabschwächung ab und bleiben bei unserem vorsichtigem Ausblick, insbesondere bezüglich der Entwicklungen, die eine nachlassende Nachfrage in Aussicht stellt. Daher bewerten wir, welche Risiken für unsere Portfoliositionen angemessen sind und welche Aktien vor diesem Hintergrund am attraktivsten wirken. Wir sehen auf kurze Sicht eine schwierigere Zeit vor uns, während die Preise dies unserer Meinung nach nicht widerspiegeln. In den weniger konjunktursensiblen Bereichen des Marktes sind wir weiter übergewichtet, was sich auf individuelle Titel bezieht, die wir für attraktiv bewertet halten und die aus den Sektoren Basiskonsumgüter, Gesundheitswesen und Versorger stammen. Wir sind nach wie vor aktive wertorientierte Large-Cap-Manager, die an ihrer Disziplin festhalten und das Portfolio nach Möglichkeit so aufstellen, dass es die interessantesten Chancen nutzen kann, die wir im aktuellen Umfeld erkennen.

US Long Short Equity – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamterrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 13,34 %. Die als Benchmark dienenden zwei Indizes, der S&P 500 Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) und der HFRX Equity Hedge Index (Total Return, USD) verbuchten im selben Zeitraum ein Plus von 25,67 % bzw. 6,90 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamterrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Das Wirtschaftsklima wurde im Verlauf des Jahres von einer Vielzahl von Faktoren geprägt, dabei u. a. Zinserhöhungen der Federal Reserve in der ersten Jahreshälfte gefolgt von einer Pause des Zinserhöhungszyklus in der zweiten Jahreshälfte.
- Trotz des verhaltenen Konjunkturausblicks legten die Märkte weiter kräftig zu, obwohl die Gewinne im S&P 500 insgesamt leicht nachgaben, was darauf zurückzuführen war, dass erhöhte Kosten auf die Margen drückten.
- Währenddessen sorgten durchwachsene Wirtschaftsdaten weiter für Volatilität auf dem Markt. Die stärksten Schwankungen betrafen die Renditekurven kurz laufender Staatsanleihen. Das rasante Zinserhöhungstempo löste auch Aktiv-Passiv-Inkongruenzen bei mehreren US-amerikanischen Regionalbanken aus, was die Sorgen um die gesamtwirtschaftliche Stabilität noch verstärkte.
- Trotz dieser Herausforderungen sorgten Zuversicht im Zusammenhang mit Fortschritten in der KI sowie ermutigende Gewinnmeldungen von Unternehmen, vor allem von Technologieriesen aus dem Mega-Cap-Segment, zumindest vorübergehend für eine gewisse Erleichterung.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Beim Gesamtertrag schnitten Long-Positionen in Aktien besser ab als der breite Markt.
 - Am vorteilhaftesten fiel die Einzeltitelauswahl unter Long-Positionen in Aktien aus den Sektoren Finanzen, Kommunikationsdienste und Industrie aus.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Das Short-Engagement auf dem Markt – darunter breite marktkapitalisierungs-, sektor- und anlagestilspezifische Absicherungen.
 - Am nachteiligsten fiel die Einzeltitelauswahl unter Long-Positionen in Aktien aus den Sektoren Nicht-Basiskonsumgüter und Werkstoffe aus.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Nettoengagement des Portfolios erhöhte sich schrittweise auf eine Netto-Long-Position von ca. 40 % bis 45 %, während sich das rechnerische Bruttoengagement in den Bereich von rund 125 % bis 130 % steigerte.
- Das fundamentale Short-Engagement verringerte sich insgesamt, allen voran durch einen Rückgang von Short-Positionen in den Sektoren Industrie, Werkstoffe und Kommunikationsdienste.
- Das Short-Engagement auf dem Markt im Zusammenhang mit Absicherungen stieg an.

Gegen Ende des Jahres 2023 hat sich gezeigt, dass sich die Wirtschaft zwar verlangsamte, aber widerstandsfähiger war als von vielen erwartet. Anfang Januar lag die Konsensusprognose für eine Rezession bei einer Wahrscheinlichkeit von 2 zu 3, doch wird das BIP-Wachstum in den USA zum Jahresende auf sehr ansehnliche 2,5 % geschätzt. Des Weiteren haben sich die Gewinnschätzungen für den S&P 500 Index trotz der Forderungen nach einer stärkeren Senkung der Gewinne für das Gesamtjahr gehalten. Der Fokus liegt nun auf 2024. Zur selben Zeit hat die Fed Fortschritte im Kampf gegen die Inflation erzielt, und die Unternehmensgewinne liegen im Durchschnitt über den Erwartungen. Dessen ungeachtet sind die Kommentare zu den nachlassenden Konsumtrends, den anhaltenden Rückgängen bei den Verkäufen bestehender Häuser und den ersten Anzeichen eines nachgebenden Arbeitsmarktes ein deutlicher Hinweis darauf, dass der Straffungszyklus der Fed reale Auswirkungen auf die Gesamtwirtschaft hat. Trotzdem hat die Fed an ihrer Verpflichtung zur Bekämpfung der Inflation festgehalten. Diese hat sich zwar weiter verlangsamt, bleibt aber in bestimmten Kernbereichen wie Lebensmittel, Löhne und Wohnimmobilien hartnäckig, wobei die unerwartet guten Wirtschaftsdaten dieses Idealszenario unterstützen. Zwar haben Offizielle der Fed nun angedeutet, dass die Zinssätze wahrscheinlich ihren Höchststand erreicht haben, doch bleibt die Ungewissheit bestehen, wie lange die Zinsen auf diesem hohen Niveau bleiben werden, da die Anleger bereits schon im März mit Zinssenkungen rechnen. Bis wir mehr Klarheit über die Entwicklung der Wirtschaft und der Inflation haben und wie sich dies in tatsächlichen Zinssenkungen gegenüber den Erwartungen niederschlägt, rechnen wir mit einer anhaltenden Marktvolatilität. Im aktuellen Umfeld dürfte sich unseres Erachtens daher im weiteren Verlauf immer klarer abzeichnen, dass sich die operative Leistung der zugrunde liegenden Unternehmen auseinanderentwickelt. Wie immer setzen wir unsere Anstrengungen zum bestmöglichen Verständnis unternehmens- und portfoliospezifischer Faktoren fort, da dieses Umfeld unseres Erachtens vom Zusammenwirken einer Vielzahl von Faktoren wie fiskalpolitische Überlegungen, geldpolitische Anreize, Sorgen um die öffentliche Gesundheit, geopolitische Unsicherheit, Rohstoffpreisvolatilität und Inflationsdynamik geprägt ist. Bei Veränderungen der Marktdynamik kann dies zu einer Verzerrung des Marktwerts von Unternehmen gegenüber ihrem langfristigen potenziellen Wert führen, was für ein volatiles Umfeld sorgt, das potenzielle Gelegenheiten eröffnet.

US Multi Cap Opportunities – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamterrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD1 I 18,10 %. Der S&P 500 Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) rentierte im selben Zeitraum 25,67 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamterrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Im Jahr 2023 zeigte sich die US-Wirtschaft in einem Umfeld mit steigenden Zinssätzen widerstandsfähig, was sich in einem positiven BIP-Wachstum, einem robusten Arbeitsmarkt und einer starken Verbrauchernachfrage ausdrückte. Die Anlegerstimmung in Bezug auf US-Aktien fand Unterstützung durch eine mäßige Inflation und eine Verbesserung der Aussichten für das globale Wachstum.
- Die Aktienmarktrenditen für den Index wurden vor allem von der Outperformance ausgewählter Large-Caps aus dem Growth-Segment und technologieorientierter Unternehmen getragen.
- Bei den Renditen am US-Aktienmarkt war die Outperformance ausgewählter Large-Caps aus dem Growth-Segment und technologieorientierter Aktien führend. Dies resultierte in einer beträchtlichen Konzentration der Marktrenditen, wie der Performanceunterschied zwischen dem Index und dem S&P 500 Equal Weight Index von 1.242 Basispunkten veranschaulicht. Dies war die seit 1998 größte Outperformance des Index gegenüber dem Equal Weight Index in einem Kalenderjahr und eröffnet Chancen für das Jahr 2024, da sich die Anlagestile in der Regel in ihrer Beliebtheit abwechseln.
- Die „Glorreichen Sieben“¹ waren in 2023 für über 60 % der Rendite des Index verantwortlich.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Eine starke Einzeltitelauswahl unter Basiskonsumgütern, in Energie, bei Finanzwerten, Werkstoffen und Versorgern
 - Eine Übergewichtung der Sektoren Kommunikationsdienste und Nicht-Basiskonsumgüter
 - Untergewichtete Positionen in den Sektoren Energie, Gesundheitswesen und Versorger und kein Engagement im Immobilienbereich
 - Unser uneingeschränkter Multi-Cap-Ansatz hat zur Identifizierung einer Reihe von Investitionen geführt, die nicht im Index enthalten sind und die sich positiv auf die relative Performance ausgewirkt haben. Im Jahr 2023 waren sechs der acht Einzelwerte mit der besten Performance Unternehmen, die nicht im Index vertreten sind.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Untergewichtung des IT-Sektors und die Einzeltitelauswahl in den Sektoren Kommunikationsdienste und Nicht-Basiskonsumgüter. Der Gegenwind für die relative Performance war im Wesentlichen darauf zurückzuführen, dass das Portfolio bei den „Glorreichen Sieben“ unterdurchschnittlich engagiert war.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

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

Wir sind der Ansicht, dass die Normalisierung der Inflation in Kombination mit einem anhaltenden Wirtschaftswachstum und einer angemessenen Verbrauchernachfrage ein attraktives Umfeld für US-Aktien im Jahr 2024 schafft. Während sich die Managementteams an das Zinsumfeld anpassen, sind wir der Auffassung, dass unser auf den freien Cashflow konzentrierter Ansatz, unser Verständnis der Kapitalstrukturen und unsere Bewertungsdisziplin von Vorteil sind. Ausgewählte Unternehmen sind im Stande, sich mit unternehmensspezifischen Lösungen von ihren Mitbewerbern abzusetzen, um auf den Inflationsdruck, die sich entwickelnden Zinssätze und die anhaltenden Veränderungen bei Nachfragetrends und Verbraucherverhalten zu reagieren. Die Tiefe unseres Wissensarchivs und Erfahrungsschatzes bleibt robust. Wir identifizieren auch weiterhin Unternehmen mit qualitativ hochwertigen Geschäftsmodellen und attraktiven freien Cashflow-Merkmalen, die zu überzeugenden Bewertungen gehandelt werden. Wir sind überzeugt, dass das Portfolio gut positioniert ist, da sich die Anleger zunehmend auf die unternehmerischen Fundamentaldaten konzentrieren.

¹ Die „Glorreichen Sieben“ ist ein Spitzname für sieben technologiebezogene Mega-Caps aus dem Wachstumssegment, die deutlich besser abgeschnitten haben als der Rest der Aktien im S&P 500® Index, und setzen sich aus Alphabet (Klasse A & C), Amazon.com, Apple, Meta Platforms, Microsoft, NVIDIA und Tesla zusammen.

US Real Estate Securities – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamterrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD 1 10,55 %. Der als Benchmark dienende FTSE Nareit All Equity REITs Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) verbuchte im selben Zeitraum 9,95 %. (Die Performance für alle Anteilsklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamterrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Der US-Aktienmarkt zog im November und Dezember kräftig an, da das Zinsumfeld für 2024 vielversprechend aussah. Die US-Notenbank sollte die Zinsen in der ersten Jahreshälfte 2024 weitgehend in der Schwebe halten und die Anleger rechnen mit Zinssenkungen in der zweiten Jahreshälfte.
- Die Inflation kühlte sich ab, und die Verbraucherausgaben blieben solide, auch wenn sie sich abschwächten. Obwohl sich das Tempo der Neueinstellungen verlangsamt hat und die Zahl der offenen Stellen zurückgegangen ist, sind die Arbeitsmärkte weiterhin stark.
- Insgesamt rentierte der S&P 500 Index im Berichtszeitraum 25,67 %. Immobilienaktiengesellschaften (REITs) rentierten im Berichtszeitraum wie vom Index gemessen mit 9,95 % und schnitten schlechter ab als der breite US-Aktienmarkt.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Die Untergewichtungen in den Sektoren Büroraum und diversifizierte Immobilien.
 - Die Einzeltitelauswahl im Sektor Büroraum.
 - Die Einzeltitelauswahl im Sektor Speciality REITs.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Die Untergewichtung in den Sektoren Rechenzentren und Beherbergung.
 - Die Einzeltitelauswahl im Sektor Rechenzentren.
 - Die Einzeltitelauswahl im Sektor Einkaufszentren-REITs.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Der Sektorpositionierung des Portfolios liegt überwiegend die Bottom-up-Einzeltitel zugrunde. Am Ende des Berichtszeitraums bestanden die größte Übergewichtungen im Verhältnis zur Benchmark in den Sektoren Selbsteinlagerung und Infrastruktur-REITs. Im Gegensatz dazu waren die im Portfolio gegenüber dem Index am stärksten untergewichteten Sektoren Rechenzentren und Büroraum.

Nach einem schwierigen Jahr 2023, das weitgehend von der geldpolitischen Straffungskampagne der Fed diktiert wurde, erscheint uns das Zinsumfeld für 2024 vielversprechend. Die US-Notenbank legt in der ersten Jahreshälfte 2024 weitgehend eine Pause ein und die Anleger rechnen mit Zinssenkungen in der zweiten Jahreshälfte. Dieses Szenario spielt sich allerdings vor dem Hintergrund einer größeren wirtschaftlichen Unsicherheit ab, die sich durch einen schwächelnden Verbraucher, der weniger spart und ein langsames Beschäftigungswachstum hinnehmen muss, das geringe Vertrauen der Unternehmen, das erhöhte Angebot in bestimmten Sektoren und die gestiegenen Kapitalkosten und Ausgaben, die die Gewinnspannen belasten, auszeichnet. Der allgemeine Druck auf das Wachstum wird dazu führen, dass den Bewertungen, der Ertragsqualität und der Stärke der unternehmerischen Fundamentaldaten mehr Aufmerksamkeit geschenkt wird, und unserer Meinung nach wird dies gut kapitalisierten REITs in ausgewählten Sektoren zugute kommen, deren Nachfrage weniger zyklisch oder nicht übermäßig verbraucherabhängig ist. Angesichts der zweijährigen relativen Underperformance von REITs gegenüber dem breiteren Markt (~20 %), des relativ niedrigen Verschuldungsprofils (~33 % Gesamtverschuldung/Bruttovermögenswert) und des stärkeren Dividendenprofils (~4 % REIT-Dividendenrendite gegenüber 1,5 % Rendite des S&P 500) bieten REITs bessere relative Werte, falls das Wachstum auf breiter Front enttäuscht oder die Kapitalkosten weiter steigen. Wir denken, dass viele REITs mit einem Abschlag auf den NIW und zu ihren privaten Pendanten gehandelt werden (~200 Bp beim Cap-Rate-Differenzial). In einem „normalen“ Inflationsumfeld und einem sich verlangsamen Wachstum bieten REITs ein langsames, aber verlässliches Wachstum und gleichzeitig einen Inflationsschutz.

US Small Cap – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 15,36 %. Der als Benchmark dienende Russell 2000 Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) verzeichnete im selben Zeitraum ein Plus von 16,41 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Der Markt setzte im Laufe des Jahres gegen mehrere Gegenwinde durch, darunter eine erhöhte Inflation, Zinserhöhungen der Federal Reserve und die Sorge, dass die Wirtschaft in eine Rezession abgleiten könnte. Die Anlegerstimmung war gegen Ende des Jahres positiv, was vor allem auf das „Umschwenken“ der Fed zurückzuführen war: Sie deutete das wahrscheinliche Ende der Zinserhöhungen und das Potenzial für Zinssenkungen im Jahr 2024 an.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Die Einzeltitelauswahl war positiv in den Sektoren Gesundheitswesen, Werkstoffe und Technologie.
 - Eine Übergewichtung der Softwarebranche innerhalb des IT-Sektors verbuchte den größten Mehrwert. Unsere Übergewichtung im Industriesektor und das Fehlen von Versorgern trugen ebenfalls erheblich zur Wertsteigerung bei.
 - Zu den individuellen Namen, die am meisten zur absoluten Performance beitrugen, gehörten Fair Isaac Corp., Manhattan Associates, Inc. und Qualys, Inc.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Bestände in den Sektoren Industrie und Finanzen belasteten die Ergebnisse.
 - Die Untergewichtung des Portfolios von Regionalbanken innerhalb des Finanzsektors und das Fehlen von Titeln aus dem Bereich Gebrauchsgüter beeinträchtigten die relative Wertentwicklung am stärksten.
 - Unter den Einzeltiteln, die die absolute Wertentwicklung am stärksten beeinträchtigten, waren Valmont Industries, Inc., Driven Brands Holdings, Inc. und CVB Financial Corp.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Der Sektorpositionierung des Portfolios liegt die Bottom-up-Einzeltitelauswahl zugrunde, und am Ende des Berichtszeitraums bestanden die größte Übergewichtungen gegenüber dem Index in den Sektoren IT und Industrie. Demgegenüber waren Finanzwerte und Immobilien am stärksten untergewichtet.

In den vergangenen zwei Jahren war die Fed voll und ganz auf die Wiederherstellung der Preisstabilität fokussiert. Dabei hatte sie das Ziel, die Nachfrage zu drosseln, um die Inflation unter Kontrolle zu bringen. Jüngste Kommentare der Fed deuten an, dass der Straffungszyklus seinen Höhepunkt erreicht hat, doch wird gleichzeitig darauf hingewiesen, dass die Zinssätze auf einem hohen Niveau bleiben werden. Die Wirtschaftstätigkeit bleibt insgesamt relativ stabil, wobei einige Indikatoren eine wirtschaftliche Abkühlung andeuten. Mit Blick auf diesen Hintergrund reagieren die Aktienmärkte weiterhin höchst empfindlich auf die Stellungnahmen der Fed, die eingehenden Daten zur Inflation und die ökonomischen Indikatoren. Wenn wir etwas Abstand nehmen, so zeigt sich, dass die Märkte möglicherweise in eine neue Phase eingetreten sind. Insbesondere sind die Kapitalkosten erheblich gestiegen, Finanzierungen sind schwieriger geworden und die Risikoaversion ist zurückgekehrt. Allerdings hat der jüngste Optimismus hinsichtlich möglicher Zinssenkungen zu einer Lockerung der finanziellen Bedingungen und zu einer erhöhten Risikobereitschaft geführt. Die Gefahr einer Rezession liegt weiter in den USA und weltweit im Bereich des Möglichen, doch dass sie eintritt, steht keinesfalls fest. Da die makroökonomische Entwicklung unsicher ist, versuchen wir, das Portfolio weiterhin ausgewogen aufzustellen. Wir sind nach wie vor zuversichtlich, dass unser qualitativ hochwertiges Portfolio aus Unternehmen mit attraktiven Finanzmerkmalen, differenzierten und beständigen Geschäftsmodellen und nachhaltigen Ertragssteigerungen gut aufgestellt ist, um diese unsicheren Zeiten zu überstehen und überdurchschnittliche risikobereinigte Ergebnisse zu liefern.

US Small Cap Intrinsic Value – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamterrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD 1 14,17 %. Der als Benchmark dienende Russell 2000 Value Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) verzeichnete im selben Zeitraum ein Plus von 13,87 %. (Die Performance für alle Anteilsklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamterrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Wer hätte gedacht, dass sich die Stimmung so schnell ändern könnte? Innerhalb von nur zwei Wochen verflüchtigte sich das Mantra „höhere Zinsen für länger“ schlagartig, nachdem es vormals den Enthusiasmus der Anleger für die meisten Aktien – wovon die „glorreichen Sieben“ – ausgenommen waren – erstickt hatte. Gerade als die höheren Zinssätze verschuldete Unternehmen und die Unternehmensgewinne erneut in Mitleidenschaft zu ziehen drohten, erinnerte sich die Federal Reserve angemessenerweise an die andere Hälfte ihres Doppelmandats, namentlich die maximale Beschäftigung.
- Unsere Einschätzung der Wirtschaft und der Inflation war konsistent. Die Inflation würde zurückgehen, wenn auch nicht auf 2 %, aber niedriger als die Niveaus, die wir 2022 und Anfang 2023 gesehen haben, und ein weitreichender Abbau von Arbeitsplätzen war unwahrscheinlich. Die Wildcard war das Bekenntnis der Fed zum 2 %-Ziel. Eine zu harte Haltung hätte unter Umständen eine Rezession zur Folge, und eine zu weiche Haltung würde die Märkte für langfristige Staatsanleihen untergraben. Ob sie das richtige Gleichgewicht gefunden hat, wird sich erst noch zeigen, aber die „große Enthüllung“, dass die Fed sich mit den Inflationsaussichten wohlfühlen beginnt, wurde äußerst positiv aufgenommen.
- Zwei beachtenswerte Ideen sind zum einen, dass die Inflation im kommenden Jahrzehnt strukturell höher sein wird als im vergangenen, und zum anderen, dass die demografischen Trends – außer es kommt zu einem großen Schock – das Risiko eines erheblichen Anstiegs der Arbeitslosigkeit verringern. Insbesondere in der verarbeitenden Industrie altern die Fachkräfte viel schneller, als dass neue Arbeitskräfte hinzukommen. Die Unternehmen berichten uns, dass der Fachkräftemangel real ist und es viel Zeit in Anspruch nimmt und teuer ist, neue Mitarbeiter auf den aktuellen der technologischen Entwicklungen zu bringen. Diese Trends stehen im Zusammenhang mit einer wichtigen Säule unserer Strategie, d. h. die Notwendigkeit von Technologien zur Bewältigung der vor uns liegenden Herausforderungen in puncto Produktivität und Arbeit. Wir sehen weiterhin säkularen Rückenwind für Unternehmen, die Produktivität verkaufen.

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

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
 - Die Übergewichtung von Technologiewerten und die Performance einzelner Titel übertrafen im Allgemeinen unsere Erwartungen und waren sowohl den absoluten als auch den relativen Renditen förderlich. Vier der fünf Unternehmen mit der besten Wertentwicklung waren IT-Unternehmen.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
 - Wir haben die regionale Bankenkrise nicht gut navigiert, da wir unsere Positionen in Banktiteln während der Talsohle nicht aufgestockt und sie dann vor der Rally im vierten Quartal reduziert haben. Das Ergebnis war sowohl absolut als auch relativ negativ.
 - Die Umschichtung der Erlöse aus dem Verkauf regionaler Banktitel in Versorger milderte die negativen Auswirkungen zwar etwas ab, aber nicht genug.
 - Unsere jüngsten aktiven Engagements und Kapitalzuführungsstrategien müssen sich erst noch auszahlen, aber wir arbeiten weiter an ihnen. Jedes Unternehmen hat andere Punkte auf der Tagesordnung, doch zielen alle darauf ab, die Bedenken der Anleger zu berücksichtigen und Lösungen vorzuschlagen, die Shareholder Value schaffen.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Wir haben die Einführung neuer Ideen in das Portfolio forciert und bestehende Beteiligungen aktiv neu gewichtet. Insgesamt haben wir zwölf neue Ideen aufgenommen und sieben eliminiert. Wir haben weitere 13 % des Portfolios umgeschichtet (8 % Prozent wurden zu bestehenden Titeln hinzugefügt und 5 % wurden gekürzt).
- Insgesamt war 2023 ein Jahr mit einer begrenzten Zahl an Fusionen und Übernahmen, doch wurden dennoch drei Unternehmen erworben und ein viertes ist Gegenstand eines Angebots. Zum Jahresende lag der Abschlag des Portfolios zum intrinsischen Wert bei 29,3 % und entsprach damit mehr oder weniger dem 26-jährigen Durchschnitt.

Was erwartet uns im Jahr 2024? Es ist schwer, das mit Überzeugung zu sagen, und ehrlich gesagt hat sich im letzten Jahr fast jeder geirrt. Die Anleger und Kunden sollten aber eine Lehre aus dem Jahr 2023 ziehen, nämlich dass nur sehr wenige Menschen oder Firmen in der Lage sind, beim Markt-Timing richtig zu liegen. Unsere Empfehlung lautet: Investieren Sie entsprechend Ihrer Risikotoleranz, legen Sie Ihre Allokation fest und bleiben Sie auf Kurs. Unserer Meinung nach sind die Risiken im Jahr 2024 offenkundig: eine dysfunktionale Innenpolitik, föderale Haushaltsungleichgewichte, Kriege in Osteuropa und im Nahen Osten mit nur minimalen Lösungsansätzen und zu allem Überfluss noch eine Präsidentschaftswahl, bei der beide Spitzenkandidaten Mängel aufweisen. Doch wenn die vor uns liegenden Herausforderungen beängstigend erscheinen, so halten wir inne und blicken zurück in die Vergangenheit. Wir begannen die Strategie vor über 25 Jahren mit 7 Mio. USD an Kundengeldern und einer persönlichen Investition von 50.000 USD. Ende 2023 belief sich das verwaltete Kundenvermögen auf 4,1 Milliarden USD, und die persönliche Investition von 50.000 USD hat nun einen Wert von etwa 750.000 USD.

¹ Die „Glorreichen Sieben“ ist ein Spitzname für sieben technologiebezogene Mega-Caps aus dem Wachstumssegment, die deutlich besser abgeschnitten haben als der Rest der Aktien im S&P 500® Index, darunter Alphabet (Klasse A & C), Amazon.com, Apple, Meta Platforms, Microsoft, NVIDIA und Tesla.

5G Connectivity - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|--|--|--------------------|---------------------------|
| Aktien 94,92 % (31. Dezember 2022: 95,96 %) | | | |
| Chinesischer Yuan Renminbi | | | |
| 1.111.700 | Foxconn Industrial Internet Co Ltd Class A | 2.360.602 | 0,23 |
| Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt | | 2.360.602 | 0,23 |
| Euro | | | |
| 38.930 | ASM International NV | 20.209.741 | 1,94 |
| 20.169 | ASML Holding NV | 15.188.061 | 1,45 |
| 96.726 | BE Semiconductor Industries NV | 14.579.461 | 1,40 |
| 541.903 | Deutsche Telekom AG | 13.019.836 | 1,25 |
| 441.142 | Infineon Technologies AG | 18.420.223 | 1,76 |
| Euro insgesamt | | 81.417.322 | 7,80 |
| Japanischer Yen | | | |
| 80.500 | Advantest Corp | 2.739.101 | 0,26 |
| 71.800 | Disco Corp | 17.815.037 | 1,71 |
| 46.700 | Keyence Corp | 20.577.415 | 1,97 |
| 1.409.100 | Renesas Electronics Corp | 25.477.344 | 2,44 |
| 159.500 | Sony Group Corp | 15.171.620 | 1,45 |
| 441.600 | TDK Corp | 21.040.057 | 2,02 |
| Japanischer Yen insgesamt | | 102.820.574 | 9,85 |
| Neuer taiwanesischer Dollar | | | |
| 399.000 | Alchip Technologies Ltd | 42.577.508 | 4,08 |
| 960.000 | Novatek Microelectronics Corp | 16.171.780 | 1,55 |
| 1.642.000 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | 31.726.625 | 3,04 |
| Neuer taiwanesischer Dollar insgesamt | | 90.475.913 | 8,67 |
| Südkoreanischer Won | | | |
| 245.713 | SK Hynix Inc | 26.816.617 | 2,57 |
| Südkoreanischer Won insgesamt | | 26.816.617 | 2,57 |
| US-Dollar | | | |
| 262.468 | Advanced Micro Devices Inc | 38.690.408 | 3,71 |
| 297.712 | Amazon.com Inc | 45.234.361 | 4,33 |
| 66.028 | Analog Devices Inc | 13.110.520 | 1,26 |
| 50.840 | Apple Inc | 9.788.225 | 0,94 |
| 50.257 | Applied Materials Inc | 8.145.152 | 0,78 |
| 90.522 | Arista Networks Inc | 21.318.836 | 2,04 |
| 93.888 | ARM Holdings Plc ADR | 7.055.214 | 0,68 |
| 94.554 | Atlassian Corp Class A | 22.490.614 | 2,16 |

5G Connectivity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|-----------------------------------|--------------------|----------------------|
| Aktien 94,92 % (31. Dezember 2022: 95,96 %) (Fortsetzung) | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | |
| 751 | Booking Holdings Inc | 2.663.962 | 0,26 |
| 27.828 | Broadcom Inc | 31.063.005 | 2,98 |
| 63.142 | Cadence Design Systems Inc | 17.197.987 | 1,65 |
| 36.538 | CrowdStrike Holdings Inc Class A | 9.328.882 | 0,89 |
| 208.542 | Dexcom Inc | 25.877.977 | 2,48 |
| 21.689 | Eaton Corp Plc | 5.223.145 | 0,50 |
| 40.394 | HubSpot Inc | 23.450.333 | 2,25 |
| 16.968 | Intuitive Surgical Inc | 5.724.324 | 0,55 |
| 528.712 | Juniper Networks Inc | 15.586.430 | 1,49 |
| 46.232 | Keysight Technologies Inc | 7.355.049 | 0,70 |
| 30.094 | Lam Research Corp | 23.571.426 | 2,26 |
| 110.353 | Meta Platforms Inc Class A | 39.060.548 | 3,74 |
| 104.445 | Microsoft Corp | 39.275.498 | 3,76 |
| 96.185 | NVIDIA Corp | 47.632.736 | 4,56 |
| 153.535 | ON Semiconductor Corp | 12.824.779 | 1,23 |
| 270.185 | Oracle Corp | 28.485.605 | 2,73 |
| 89.541 | Palo Alto Networks Inc | 26.403.850 | 2,53 |
| 387.433 | Pure Storage Inc Class A | 13.815.861 | 1,32 |
| 82.442 | QUALCOMM Inc | 11.923.586 | 1,14 |
| 70.500 | Salesforce Inc | 18.551.370 | 1,78 |
| 46.461 | ServiceNow Inc | 32.824.232 | 3,15 |
| 70.675 | Shopify Inc Class A | 5.505.582 | 0,53 |
| 99.153 | Super Micro Computer Inc | 28.185.232 | 2,70 |
| 32.369 | Take-Two Interactive Software Inc | 5.209.791 | 0,50 |
| 211.655 | T-Mobile US Inc | 33.934.646 | 3,25 |
| 36.641 | Workday Inc Class A | 10.115.114 | 0,97 |
| | US-Dollar insgesamt | 686.624.280 | 65,80 |
| | Aktien insgesamt * | 990.515.308 | 94,92 |
| | Anlagen insgesamt | 990.515.308 | 94,92 |

Devisenterminkontrakte 0,61 % (31. Dezember 2022: 1,22 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> | | | | | | |
| 3.948.394 AUD | 2.579.979 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 13 | 115.612 | 0,01 |
| 696.985 AUD | 456.183 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 3 | 19.652 | 0,00 |
| 573.103 AUD | 370.991 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | 20.269 | 0,00 |
| 21.900.510 AUD | 14.130.556 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 35 | 821.036 | 0,08 |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> | | | | | | |
| 76.928 CHF | 85.632 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 4 | 5.919 | 0,00 |

5G Connectivity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 0,61 % (31. Dezember 2022: 1,22 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen CHF (Fortsetzung)</i> | | | | | | |
| 13.950 CHF | 15.761 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 12 | 840 | 0,00 |
| 6.770 CHF | 7.724 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 7 | 333 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen CNY</i> | | | | | | |
| 291.481 CNY | 40.233 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 5 | 746 | 0,00 |
| 3.472.387 CNY | 478.736 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 18 | 9.446 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 9.456.865 € | 10.275.297 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 9 | 177.730 | 0,02 |
| 88.894.777 € | 94.834.454 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 12 | 3.424.281 | 0,33 |
| 5.721.251 € | 6.153.273 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 37 | 170.643 | 0,02 |
| 6.241 US\$ | 5.616 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | 33 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 694.483 £ | 857.131 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 6 | 28.274 | 0,00 |
| 87.018 £ | 109.007 US\$ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 1.933 | 0,00 |
| 311.667 £ | 388.722 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 3 | 8.627 | 0,00 |
| 9.362.705 £ | 11.500.516 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 5 | 436.106 | 0,04 |
| 1.531.567 £ | 1.896.544 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 15 | 56.069 | 0,01 |
| 47.111 US\$ | 36.889 £ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | 81 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen HKD</i> | | | | | | |
| 5.654.265 HKD | 723.620 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 6 | 741 | 0,00 |
| 1.472.853 HKD | 188.630 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 3 | 56 | 0,00 |
| 62.389.405 HKD | 7.989.483 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 8 | 3.156 | 0,00 |
| 2.383.665 HKD | 305.191 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 17 | 178 | 0,00 |
| 54.343 US\$ | 423.661 HKD | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 68 | 0,00 |
| 1.933.508 US\$ | 15.070.344 HKD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 15 | 2.862 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i> | | | | | | |
| 2.336.338 SGD | 1.724.430 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | 48.027 | 0,01 |
| 508.702 SGD | 379.575 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 6.351 | 0,00 |
| 1.418.044 SGD | 1.064.895 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 3 | 10.900 | 0,00 |
| 44.816.988 SGD | 33.045.101 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 55 | 955.178 | 0,09 |
| 28 US\$ | 37 SGD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 0 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i> | | | | | | |
| 114 US\$ | 2.094 ZAR | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | 0 | 0,00 |
| 690.828 ZAR | 37.274 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 10 | 451 | 0,00 |
| 5.045.789 ZAR | 260.909 US\$ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 3 | 14.638 | 0,00 |
| 3.318.193 ZAR | 179.218 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 18 | 1.986 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | 6.342.222 | 0,61 |

5G Connectivity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|--|--------------------|------------------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 996.857.530 | 95,53 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,10 %) (31. Dezember 2022: (0,33 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> | | | | | | |
| 147.263 AUD | 100.812 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | (274) | (0,00) |
| 992.393 US\$ | 1.546.473 AUD | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 5 | (63.392) | (0,01) |
| 361.008 US\$ | 563.241 AUD | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 2 | (23.520) | (0,00) |
| 67.197 US\$ | 106.027 AUD | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (5.188) | (0,00) |
| 2.671.718 US\$ | 4.084.378 AUD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 26 | (116.707) | (0,01) |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> | | | | | | |
| 597 CHF | 711 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (1) | (0,00) |
| 3.196 US\$ | 2.824 CHF | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 3 | (165) | (0,00) |
| 8.541 US\$ | 7.512 CHF | 18.01.2024 | UBS AG | 6 | (399) | (0,00) |
| 1.321 US\$ | 1.182 CHF | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (86) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen CNY</i> | | | | | | |
| 94.683 CNY | 13.324 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | (12) | (0,00) |
| 17.038 US\$ | 122.883 CNY | 18.01.2024 | UBS AG | 3 | (239) | (0,00) |
| 167.973 US\$ | 1.209.849 CNY | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 9 | (2.119) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 588.981 € | 652.583 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (1.560) | (0,00) |
| 47.149 € | 52.403 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | (288) | (0,00) |
| 3.694.028 US\$ | 3.442.660 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | (111.274) | (0,01) |
| 2.407.467 US\$ | 2.255.602 € | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 2 | (85.735) | (0,01) |
| 15.204.155 US\$ | 14.078.907 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 86 | (357.788) | (0,03) |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 139.155 £ | 177.995 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (585) | (0,00) |
| 221.950 US\$ | 182.697 £ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (10.972) | (0,00) |
| 407.734 US\$ | 330.105 £ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 3 | (13.121) | (0,00) |
| 439.114 US\$ | 355.200 £ | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | (13.734) | (0,00) |
| 2.409.476 US\$ | 1.941.754 £ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 21 | (66.091) | (0,01) |
| <i>Abgesicherte Klassen HKD</i> | | | | | | |
| 1.377.027 HKD | 176.649 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (239) | (0,00) |
| 1.881.137 HKD | 241.157 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 3 | (166) | (0,00) |
| 1.815.417 HKD | 232.671 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (100) | (0,00) |
| 123.038 HKD | 15.782 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 7 | (18) | (0,00) |
| 161.705 US\$ | 1.262.698 HKD | 18.01.2024 | BNP Paribas | 1 | (58) | (0,00) |
| 208.371 US\$ | 1.627.981 HKD | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (187) | (0,00) |

5G Connectivity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (0,10 %) (31. Dezember 2022: (0,33 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen HKD (Fortsetzung)</i> | | | | | | |
| 51.443 US\$ | 401.730 HKD | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | (22) | (0,00) |
| 295.731 US\$ | 2.310.628 HKD | 18.01.2024 | UBS AG | 3 | (281) | (0,00) |
| 819.287 US\$ | 6.401.992 HKD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 19 | (867) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i> | | | | | | |
| 306.133 SGD | 232.263 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | (16) | (0,00) |
| 771.793 US\$ | 1.054.366 SGD | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (28.098) | (0,00) |
| 1.038.734 US\$ | 1.403.661 SGD | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 3 | (26.149) | (0,00) |
| 1.900.650 US\$ | 2.567.998 SGD | 18.01.2024 | UBS AG | 4 | (47.554) | (0,01) |
| 1.783.972 US\$ | 2.418.897 SGD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 48 | (51.116) | (0,01) |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i> | | | | | | |
| 16.471 US\$ | 309.152 ZAR | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (412) | (0,00) |
| 165.051 US\$ | 3.109.718 ZAR | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 17 | (4.769) | (0,00) |
| 974 US\$ | 17.977 ZAR | 02.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (9) | (0,00) |
| 160.888 ZAR | 8.795 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (10) | (0,00) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | (1.033.321) | (0,10) |
| | | | | | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | | | | | (1.033.321) | (0,10) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | | | | | 995.824.209 | 95,43 |
| Sonstiges Nettovermögen | | | | | 47.702.734 | 4,57 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | | | | | 1.043.526.943 | 100,00 |
| Portfolioanalyse | | | | | US\$ | % des Gesamtvermögens |
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | | | | | 990.515.308 | 94,01 |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente | | | | | 5.308.901 | 0,50 |
| Anlagen insgesamt | | | | | 995.824.209 | 94,51 |

Absolute Return Multi Strategy - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|--|--------------------------------|------------------|------------------------------|
| Aktien 100,00 % (31. Dezember 2022: 100,00 %) | | | |
| US-Dollar | | | |
| 12.622 | Achillion Pharmaceuticals Inc* | 6.311 | 100,00 |
| 1.356 | Clementia Pharmaceuticals Inc† | 0 | 0,00 |
| 1.250 | Tobira Therapeutics Inc† | 0 | 0,00 |
| Aktien insgesamt | | 6.311 | 100,00 |
| Anlagen insgesamt | | 6.311 | 100,00 |

| | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|------------------|------------------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 6.311 | 100,00 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | 6.311 | 100,00 |
| Sonstige Nettoverbindlichkeiten | (6.311) | (100,00) |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | 0 | 0,00 |

| Portfolioanalyse | US\$ | % des Gesamtver- mögens |
|---|--------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 6.311 | 5,90 |
| † Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente | 0 | 0,00 |
| Anlagen insgesamt | 6.311 | 5,90 |

China A-Share Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert CNY | % des Nettovermögens |
|--|---|--------------|----------------------|
| Aktien 94,84 % (31. Dezember 2022: 94,31 %) | | | |
| Chinesischer Yuan Renminbi | | | |
| 1.100 | Anjoy Foods Group Co Ltd Class A | 115.071 | 0,81 |
| 35.200 | Baoshan Iron & Steel Co Ltd Class A | 208.736 | 1,47 |
| 700 | BYD Co Ltd Class A | 138.600 | 0,97 |
| 6.300 | Centre Testing International Group Co Ltd Class A | 89.460 | 0,63 |
| 92.500 | China Construction Bank Corp Class A | 602.175 | 4,24 |
| 16.800 | China Galaxy Securities Co Ltd Class A | 202.440 | 1,42 |
| 12.400 | China Yangtze Power Co Ltd Class A | 289.416 | 2,04 |
| 5.600 | Chongqing Department Store Co Ltd Class A | 157.920 | 1,11 |
| 6.800 | CITIC Securities Co Ltd Class A | 138.516 | 0,97 |
| 1.300 | Contemporary Amperex Technology Co Ltd Class A | 212.238 | 1,49 |
| 9.800 | Dongfang Electric Corp Ltd Class A | 143.276 | 1,01 |
| 11.900 | First Tractor Co Ltd Class A | 173.383 | 1,22 |
| 10.500 | Fuyao Glass Industry Group Co Ltd Class A | 392.595 | 2,76 |
| 3.232 | Giantec Semiconductor Corp Class A | 197.896 | 1,39 |
| 6.100 | Henan Shuanghui Investment & Development Co Ltd Class A | 162.931 | 1,15 |
| 14.600 | Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd Class A | 390.550 | 2,75 |
| 7.120 | Jiangsu Hengrui Pharmaceuticals Co Ltd Class A | 322.038 | 2,27 |
| 7.000 | Jinzai Food Group Co Ltd Class A | 85.540 | 0,60 |
| 700 | Kweichow Moutai Co Ltd Class A | 1.208.200 | 8,50 |
| 13.800 | Luxshare Precision Industry Co Ltd Class A | 475.410 | 3,34 |
| 600 | Luzhou Laojiao Co Ltd Class A | 107.652 | 0,76 |
| 11.300 | Midea Group Co Ltd Class A | 617.319 | 4,34 |
| 12.104 | NARI Technology Co Ltd Class A | 270.161 | 1,90 |
| 3.501 | Piesat Information Technology Co Ltd Class A | 147.882 | 1,04 |
| 6.500 | Ping An Insurance Group Co of China Ltd Class A | 261.950 | 1,84 |
| 24.000 | Poly Developments & Holdings Group Co Ltd Class A | 237.600 | 1,67 |
| 1.800 | Proya Cosmetics Co Ltd Class A | 178.920 | 1,26 |
| 13.100 | Sany Heavy Industry Co Ltd Class A | 180.387 | 1,27 |
| 500 | Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co Ltd Class A | 115.365 | 0,81 |
| 4.700 | Shenzhen Inovance Technology Co Ltd Class A | 296.758 | 2,09 |
| 1.922 | Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd Class A | 558.533 | 3,93 |
| 50.100 | Shenzhen MTC Co Ltd Class A | 279.558 | 1,97 |
| 8.100 | Shenzhen Sunlord Electronics Co Ltd Class A | 218.781 | 1,54 |
| 8.200 | Shenzhen YUTO Packaging Technology Co Ltd Class A | 225.582 | 1,59 |
| 1.800 | Sungrow Power Supply Co Ltd Class A | 157.662 | 1,11 |
| 10.500 | TongFu Microelectronics Co Ltd Class A | 242.760 | 1,71 |
| 4.308 | Tsingtao Brewery Co Ltd Class A | 322.023 | 2,27 |
| 2.700 | Wanhua Chemical Group Co Ltd Class A | 207.414 | 1,46 |
| 15.500 | Weichai Power Co Ltd Class A | 211.575 | 1,49 |

China A-Share Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert CNY | % des Nettovermögens |
|---|--|---------------------|------------------------------|
| Aktien 94,84 % (31. Dezember 2021: 94,31 %) (Fortsetzung) | | | |
| Chinesischer Yuan Renminbi (Fortsetzung) | | | |
| 1.975 | Wuliangye Yibin Co Ltd Class A | 277.112 | 1,95 |
| 5.130 | Yifeng Pharmacy Chain Co Ltd Class A | 205.405 | 1,44 |
| 13.100 | Yizumi Holdings Co Ltd Class A | 230.953 | 1,62 |
| 5.900 | Zhejiang Jiemei Electronic & Technology Co Ltd Class A | 147.205 | 1,04 |
| 5.000 | Zhejiang Sanhua Intelligent Controls Co Ltd Class A | 147.000 | 1,03 |
| 9.800 | Zhejiang Weixing New Building Materials Co Ltd Class A | 141.806 | 1,00 |
| Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt | | 11.693.754 | 82,27 |
| Hongkong-Dollar | | | |
| 28.000 | AK Medical Holdings Ltd | 159.838 | 1,13 |
| 78.000 | China CITIC Bank Corp Ltd - H Shares | 261.751 | 1,84 |
| 24.000 | China Life Insurance Co Ltd - H Shares | 221.482 | 1,56 |
| 10.000 | China Medical System Holdings Ltd | 126.207 | 0,89 |
| 50.000 | Nexteer Automotive Group Ltd | 224.783 | 1,58 |
| 12.000 | SciClone Pharmaceuticals Holdings Ltd | 152.323 | 1,07 |
| 3.700 | Shenzhou International Group Holdings Ltd | 271.271 | 1,91 |
| 53.000 | Sinotrans Ltd - H Shares | 158.041 | 1,11 |
| 400 | Tencent Holdings Ltd | 107.093 | 0,75 |
| 18.000 | Yuexiu Property Co Ltd | 104.394 | 0,73 |
| Hongkong-Dollar insgesamt | | 1.787.183 | 12,57 |
| Aktien insgesamt * | | 13.480.937 | 94,84 |
| Anlagen insgesamt | | 13.480.937 | 94,84 |
| | | Zeitwert CNY | % des Nettovermögens |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | | 13.480.937 | 94,84 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | | 13.480.937 | 94,84 |
| Sonstiges Nettovermögen | | 732.895 | 5,16 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | | 14.213.832 | 100,00 |
| Portfolioanalyse | | CNY | % des Gesamtvermögens |
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | | 13.480.937 | 91,24 |
| Anlagen insgesamt | | 13.480.937 | 91,24 |

China Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert CNY | % des Nettover- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Einlagenzertifikate 12,76 % (31. Dezember 2022: 20,52 %) | | | | | |
| Chinesischer Yuan Renminbi | | | | | |
| 20.000.000 | Agricultural Bank of China Ltd** | 2,63 % | 23.04.2024 | 19.502.400 | 4,25 |
| 20.000.000 | Bank of Communications Co Ltd* | 2,33 % | 13.06.2024 | 19.536.820 | 4,26 |
| 20.000.000 | China Citic Bank Corp* | 2,49 % | 22.05.2024 | 19.517.780 | 4,25 |
| Einlagenzertifikat insgesamt | | | | 58.557.000 | 12,76 |
| Unternehmensanleihen 63,24 % (31. Dezember 2022: 60,07 %) | | | | | |
| Chinesischer Yuan Renminbi | | | | | |
| 10.000.000 | Agricultural Bank of China Ltd** | 4,30 % | 11.04.2029 | 10.054.225 | 2,19 |
| 1.300.000 | Bank of Chengdu Co Ltd* | 0,40 % | 03.03.2028 | 1.459.432 | 0,32 |
| 20.000.000 | Bright Food Group Co Ltd* | 3,25 % | 12.07.2024 | 20.077.390 | 4,37 |
| 10.000.000 | Central Huijin Investment Ltd** | 2,44 % | 11.11.2025 | 9.982.850 | 2,18 |
| 10.000.000 | Central Huijin Investment Ltd** | 2,80 % | 27.10.2026 | 10.047.720 | 2,19 |
| 10.000.000 | China Minmetals Corp** | 2,54 % | 04.11.2025 | 9.979.585 | 2,17 |
| 10.000.000 | China Post Group Co Ltd* | 2,84 % | 20.01.2025 | 10.031.820 | 2,19 |
| 20.000.000 | China Resources Inc* | 2,90 % | 22.04.2025 | 20.092.520 | 4,38 |
| 2.895.000 | China Southern Airlines Co Ltd* | 0,80 % | 15.10.2026 | 3.474.174 | 0,76 |
| 20.000.000 | China Southern Power Grid Co Ltd** | 2,84 % | 24.11.2025 | 20.110.660 | 4,38 |
| 10.000.000 | China Three Gorges Renewables Group Co Ltd** | 2,65 % | 21.02.2025 | 10.016.095 | 2,18 |
| 840.000 | Ecovacs Robotics Co Ltd* | 1,00 % | 30.11.2027 | 867.350 | 0,19 |
| 400.000 | Great Wall Motor Co Ltd* | 0,60 % | 10.06.2027 | 430.832 | 0,09 |
| 950.000 | Guangxi LiuYao Group Co Ltd* | 1,50 % | 16.01.2026 | 1.117.979 | 0,24 |
| 20.000.000 | Guangzhou Yuexiu Holding Ltd** | 3,00 % | 21.04.2025 | 20.092.150 | 4,38 |
| 10.000.000 | Guotai Junan Securities Co Ltd* | 3,16 % | 15.02.2026 | 10.108.760 | 2,20 |
| 1.450.000 | Hangzhou First Applied Material Co Ltd* | 0,30 % | 22.11.2028 | 1.527.024 | 0,33 |
| 800.000 | Hunan Changyuan Lico Co Ltd* | 0,50 % | 11.10.2028 | 791.072 | 0,17 |
| 700.000 | iRay Technology Co Ltd* | 0,40 % | 24.10.2028 | 996.716 | 0,22 |
| 750.000 | Lepu Medical Technology Beijing Co Ltd* | 1,00 % | 30.03.2026 | 825.015 | 0,18 |
| 3.150.000 | LONGi Green Energy Technology Co Ltd* | 0,40 % | 05.01.2028 | 3.240.500 | 0,71 |
| 1.700.000 | Luxshare Precision Industry Co Ltd* | 1,50 % | 03.11.2026 | 1.868.300 | 0,40 |
| 400.000 | Ningbo Tuopu Group Co Ltd* | 0,40 % | 14.07.2028 | 514.836 | 0,11 |
| 1.000.000 | Sailun Group Co Ltd* | 0,50 % | 02.11.2028 | 1.349.370 | 0,30 |
| 800.000 | Shanying International Holding Co Ltd* | 3,00 % | 21.11.2024 | 878.056 | 0,19 |
| 650.000 | Sichuan Kelun Pharmaceutical Co Ltd* | 0,40 % | 18.03.2028 | 1.177.150 | 0,26 |
| 770.000 | Sinocare Inc* | 1,50 % | 21.12.2026 | 943.250 | 0,21 |
| 1.080.000 | Tongwei Co Ltd* | 0,40 % | 24.02.2028 | 1.170.947 | 0,25 |
| 420.000 | Wingtech Technology Co Ltd* | 0,30 % | 28.07.2027 | 445.041 | 0,10 |
| 800.000 | Zhejiang Huahai Pharmaceutical Co Ltd* | 1,50 % | 02.11.2026 | 865.016 | 0,19 |

China Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert CNY | % des Netto- vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|--------------------|---------------------------|
| Unternehmensanleihen 63,24 % (31. Dezember 2022: 60,07 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Chinesischer Yuan Renminbi (Fortsetzung) | | | | | |
| 1.100.000 | Zheshang Securities Co Ltd* | 0,40 % | 14.06.2028 | 1.376.144 | 0,30 |
| 400.000 | Zhuzhou Kibing Group Co Ltd* | 0,60 % | 09.04.2027 | 437.000 | 0,10 |
| Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt | | | | 176.348.979 | 38,43 |
| United States Dollar | | | | | |
| 1.000.000 | Blossom Joy Ltd* | 3,10 % | 29.12.2049 | 6.813.133 | 1,49 |
| 2.000.000 | BOC Aviation USA Corp* | 1,63 % | 29.04.2024 | 14.061.993 | 3,07 |
| 1.000.000 | China Hongqiao Group Ltd* | 6,25 % | 08.06.2024 | 7.076.800 | 1,54 |
| 1.000.000 | China Mengniu Dairy Co Ltd* | 3,00 % | 18.07.2024 | 7.035.046 | 1,53 |
| 1.500.000 | ENN Clean Energy International Investment Ltd* | 3,38 % | 12.05.2026 | 10.022.864 | 2,19 |
| 2.000.000 | Guangzhou Metro Investment Finance BVI Ltd** | 1,51 % | 17.09.2025 | 13.364.600 | 2,91 |
| 1.000.000 | Haitong International Securities Group Ltd** | 3,38 % | 19.07.2024 | 7.031.949 | 1,53 |
| 500.000 | Huarong Finance 2019 Co Ltd* | 3,75 % | 29.05.2024 | 3.512.272 | 0,77 |
| 1.000.000 | Huarong Finance II Co Ltd* | 5,50 % | 16.01.2025 | 7.058.295 | 1,54 |
| 500.000 | Sands China Ltd** | 4,30 % | 08.01.2026 | 3.421.193 | 0,75 |
| 1.000.000 | Shanghai Port Group BVI Development 2 Co Ltd* | 1,50 % | 13.07.2025 | 6.750.649 | 1,47 |
| 1.300.000 | Sinochem Offshore Capital Co Ltd* | 1,00 % | 23.09.2024 | 8.964.266 | 1,95 |
| 697.000 | Studio City Finance Ltd** | 6,00 % | 15.07.2025 | 4.863.225 | 1,06 |
| 1.000.000 | Tencent Holdings Ltd* | 3,98 % | 11.04.2029 | 6.779.456 | 1,48 |
| 1.000.000 | TFI Overseas Investment Ltd* | 6,50 % | 05.06.2024 | 7.049.394 | 1,53 |
| US-Dollar insgesamt | | | | 113.805.135 | 24,81 |
| Unternehmensanleihen insgesamt | | | | 290.154.114 | 63,24 |
| Staatsanleihen 20,89 % (31. Dezember 2022: 13,26 %) | | | | | |
| Chinesischer Yuan Renminbi | | | | | |
| 30.000.000 | China Government Bond | 2,18 % | 15.08.2026 | 29.923.935 | 6,52 |
| 9.500.000 | China Government Bond | 2,39 % | 15.11.2026 | 9.527.654 | 2,08 |
| 46.000.000 | China Government Bond | 2,67 % | 25.05.2033 | 46.311.328 | 10,09 |
| 10.000.000 | China Government Bond | 2,69 % | 12.08.2026 | 10.095.765 | 2,20 |
| Staatsanleihen insgesamt ** | | | | 95.858.682 | 20,89 |
| Anlagen insgesamt | | | | 444.569.796 | 96,89 |

Devisenterminkontrakte 0,42 % (31. Dezember 2022: 0,87 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeits- datum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn CNY | % des Nettover- mögens |
|-----------------------|------------------------|-----------------------|-------------------------|-----------|-------------------------------------|------------------------------|
| 88.647.125 CNY | 12.250.000 US\$ | 25.03.2024 | Citibank NA | 1 | 1.917.777 | 0,42 |
| 4.624.724 CNY | 650.000 US\$ | 25.03.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 22.759 | 0,00 |
| 500.000 US\$ | 3.554.265 CNY | 19.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 1.897 | 0,00 |

China Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 0,42 % (31. Dezember 2022: 0,87 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn CNY | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|---------------------|-----------|-------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 20.808 £ | 186.698 CNY | 14.03.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | 1.318 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | 1.943.751 | 0,42 |

Futures-Kontrakte 0,13 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Gewinn CNY | % des Nettovermögens |
|--|---|-------------------------------|----------------------|
| 35 | US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2024 | 603.582 | 0,13 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten [*] | | | 603.582 |

| | Zeitwert CNY | % des Nettovermögens |
|--|--------------------|----------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 447.117.129 | 97,44 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,51 %) (31. Dezember 2022: (0,60 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust CNY | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 10.719.177 CNY | 1.518.183 US\$ | 19.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | (78.634) | (0,02) |
| 47.256.298 CNY | 6.699.125 US\$ | 19.01.2024 | UBS AG | 1 | (390.056) | (0,08) |
| 3.708.407 US\$ | 26.709.116 CNY | 19.01.2024 | Citibank NA | 4 | (333.720) | (0,07) |
| 736.224 US\$ | 5.343.470 CNY | 25.03.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | (131.043) | (0,03) |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 2.816 CNY | 365 € | 18.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (56) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen USD</i> | | | | | | |
| 49.144.920 US\$ | 349.647.976 CNY | 14.03.2024 | UBS AG | 2 | (1.428.436) | (0,31) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | (2.361.945) | (0,51) |

| | Zeitwert CNY | % des Nettovermögens |
|---|--------------------|----------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (2.361.945) | (0,51) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | 444.755.184 | 96,93 |
| Sonstiges Nettovermögen | 14.090.924 | 3,07 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | 458.846.108 | 100,00 |

China Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

| Portfolioanalyse | CNY | % des Gesamtver- mögens |
|---|--------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 210.244.462 | 45,47 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 234.325.334 | 50,67 |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 603.582 | 0,13 |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente | (418.194) | (0,09) |
| Anlagen insgesamt | 444.755.184 | 96,18 |

China Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|--|---|--------------------|------------------------------|
| Aktien 96,46 % (31. Dezember 2022: 96,67 %) | | | |
| Chinesischer Yuan Renminbi | | | |
| 1.300.072 | Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd Class A | 4.883.988 | 2,74 |
| 200.000 | Jiangsu Hengli Hydraulic Co Ltd Class A | 1.535.826 | 0,86 |
| 2.649.953 | Luxshare Precision Industry Co Ltd Class A | 12.820.673 | 7,19 |
| 1.150.031 | Midea Group Co Ltd Class A | 8.823.160 | 4,95 |
| 154.414 | Milkyway Chemical Supply Chain Service Co Ltd Class A | 1.153.887 | 0,65 |
| 5.395.916 | Satellite Chemical Co Ltd Class A | 11.177.395 | 6,27 |
| 729.058 | Shandong Hualu Hengsheng Chemical Co Ltd Class A | 2.824.862 | 1,59 |
| 370.127 | Shenzhen Inovance Technology Co Ltd Class A | 3.282.001 | 1,84 |
| 475.035 | Shenzhen Sunlord Electronics Co Ltd Class A | 1.801.912 | 1,01 |
| 220.471 | Suzhou Maxwell Technologies Co Ltd Class A | 4.009.943 | 2,25 |
| 775.059 | Wanhua Chemical Group Co Ltd Class A | 8.361.659 | 4,69 |
| 700.094 | Yunnan Energy New Material Co Ltd Class A | 5.586.515 | 3,14 |
| 310.200 | Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co Ltd Class A | 1.920.726 | 1,08 |
| 6.806.103 | Zoomlion Heavy Industry Science & Technology Co Ltd Class A | 6.241.588 | 3,50 |
| Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt | | 74.424.135 | 41,76 |
| Hongkong-Dollar | | | |
| 1.304.000 | Akeso Inc | 7.748.634 | 4,35 |
| 800.000 | Alibaba Group Holding Ltd | 7.745.356 | 4,34 |
| 1.300.000 | China Merchants Bank Co Ltd - H Shares | 4.528.370 | 2,54 |
| 3.767.600 | China Pacific Insurance Group Co Ltd - H Shares | 7.604.149 | 4,27 |
| 1.976.000 | China Resources Beer Holdings Co Ltd | 8.654.513 | 4,86 |
| 1.370.000 | China Resources Land Ltd | 4.912.564 | 2,76 |
| 23.000 | Cowell e Holdings Inc | 67.894 | 0,04 |
| 7.000.000 | CSPC Pharmaceutical Group Ltd | 6.508.251 | 3,65 |
| 3.500.000 | Haier Smart Home Co Ltd - H Shares | 9.883.397 | 5,54 |
| 550.000 | Meituan Class B | 5.768.677 | 3,24 |
| 151.500 | Shenzhou International Group Holdings Ltd | 1.559.905 | 0,87 |
| 499.000 | SITC International Holdings Co Ltd | 861.430 | 0,48 |
| 272.500 | Tencent Holdings Ltd | 10.245.948 | 5,75 |
| 340.000 | Zhongsheng Group Holdings Ltd | 813.365 | 0,46 |
| Hongkong-Dollar insgesamt | | 76.902.453 | 43,15 |
| US-Dollar | | | |
| 320.311 | Trip.com Group Ltd ADR | 11.534.399 | 6,47 |
| 425.534 | ZTO Express Cayman Inc ADR | 9.055.364 | 5,08 |
| US-Dollar insgesamt | | 20.589.763 | 11,55 |
| Aktien insgesamt * | | 171.916.351 | 96,46 |
| Anlagen insgesamt | | 171.916.351 | 96,46 |

China Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 0,31 % (31. Dezember 2022: 0,35 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|-----------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> | | | | | | |
| 2.970 CHF | 3.295 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 240 | 0,00 |
| 12.468 CHF | 14.066 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 5 | 772 | 0,00 |
| 307.640 CHF | 344.184 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 9 | 21.932 | 0,01 |
| 1.184 US\$ | 994 CHF | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | 1 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 105.852 € | 115.048 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 4 | 1.954 | 0,00 |
| 4.179.735 € | 4.454.604 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 4 | 165.414 | 0,10 |
| 4.235.456 € | 4.511.673 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 11 | 169.935 | 0,10 |
| 12.522 US\$ | 11.302 € | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | 30 | 0,00 |
| 77.807 US\$ | 70.020 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 411 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 407 £ | 505 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | 14 | 0,00 |
| 11.341 £ | 13.932 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 4 | 527 | 0,00 |
| 1.197 £ | 1.478 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 8 | 47 | 0,00 |
| 216 US\$ | 169 £ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 1 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i> | | | | | | |
| 8.081.356 SGD | 5.947.663 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 5 | 183.234 | 0,10 |
| 40.041 SGD | 30.143 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | 234 | 0,00 |
| 157.764 SGD | 117.215 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 9 | 2.474 | 0,00 |
| 8.140 US\$ | 10.730 SGD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | 0 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | 547.220 | 0,31 |
| | | | | | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | | | | | 172.463.571 | 96,77 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,24 %) (31. Dezember 2022: (0,26 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> | | | | | | |
| 5.382 CHF | 6.422 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (17) | (0,00) |
| 10.023 US\$ | 8.866 CHF | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 6 | (528) | (0,00) |
| 43.219 US\$ | 37.998 CHF | 18.01.2024 | UBS AG | 16 | (2.002) | (0,00) |
| 130.948 US\$ | 116.394 CHF | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 6 | (7.571) | (0,01) |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 60.632 € | 67.093 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (74) | (0,00) |
| 176.076 US\$ | 162.208 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 7 | (3.218) | (0,00) |

China Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (0,26 %) (31. Dezember 2021: (0,05 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR (Fortsetzung)</i> | | | | | | |
| 3.431.985 US\$ | 3.218.073 € | 18.01.2024 | UBS AG | 7 | (125.073) | (0,07) |
| 3.573.281 US\$ | 3.352.868 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 29 | (132.773) | (0,08) |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 342 £ | 436 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (0) | (0,00) |
| 1.338 US\$ | 1.082 £ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 9 | (42) | (0,00) |
| 566 US\$ | 458 £ | 18.01.2024 | UBS AG | 3 | (19) | (0,00) |
| 1.545 US\$ | 1.235 £ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 12 | (29) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i> | | | | | | |
| 48.386 SGD | 36.714 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (6) | (0,00) |
| 4.744.618 US\$ | 6.446.588 SGD | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 5 | (146.066) | (0,08) |
| 104.825 US\$ | 141.070 SGD | 18.01.2024 | UBS AG | 9 | (2.199) | (0,00) |
| 191.730 US\$ | 257.640 SGD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 22 | (3.727) | (0,00) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | (423.344) | (0,24) |
| | | | | | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | | | | | (423.344) | (0,24) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | | | | | 172.040.227 | 96,53 |
| Sonstiges Nettovermögen | | | | | 6.186.060 | 3,47 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | | | | | 178.226.287 | 100,00 |
| Portfolioanalyse | | | | | US\$ | % des Gesamtvermögens |
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | | | | | 171.916.351 | 95,78 |
| [∞] OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente | | | | | 123.876 | 0,07 |
| Anlagen insgesamt | | | | | 172.040.227 | 95,85 |

Climate Innovation – Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|---|---|------------------|------------------------------|
| Aktien 96,88 % | | | |
| Chinesischer Yuan Renminbi | | | |
| 1.000 | Contemporary Ampere Technology Co Ltd Class A | 22.928 | 0,78 |
| Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt | | 22.928 | 0,78 |
| Euro | | | |
| 513 | Arkema SA | 58.369 | 2,00 |
| 843 | Danone SA | 54.644 | 1,87 |
| 1.272 | DSM-Firmenich AG | 129.270 | 4,42 |
| 5.339 | Iberdrola SA | 70.006 | 2,39 |
| 4.762 | Stellantis NV | 111.256 | 3,81 |
| Euro insgesamt | | 423.545 | 14,49 |
| Hongkong-Dollar | | | |
| 3.000 | BYD Co Ltd - H Shares | 82.371 | 2,82 |
| 1.300 | Li Auto Inc Class A | 24.490 | 0,84 |
| Hongkong-Dollar insgesamt | | 106.861 | 3,66 |
| Japanischer Yen | | | |
| 1.200 | Hitachi Ltd | 86.566 | 2,96 |
| Japanischer Yen insgesamt | | 86.566 | 2,96 |
| Norwegische Krone | | | |
| 5.262 | Aker Carbon Capture ASA | 7.036 | 0,24 |
| Norwegische Krone insgesamt | | 7.036 | 0,24 |
| Britisches Pfund | | | |
| 1.320 | CRH Plc | 91.036 | 3,12 |
| Britisches Pfund insgesamt | | 91.036 | 3,12 |
| Südkoreanischer Won | | | |
| 1.576 | Kia Corp | 121.877 | 4,17 |
| 301 | L&F Co Ltd | 47.247 | 1,61 |
| 116 | LG Chem Ltd | 44.616 | 1,53 |
| 44 | LG Energy Solution Ltd | 14.521 | 0,50 |
| Südkoreanischer Won insgesamt | | 228.261 | 7,81 |
| Schweizer Franken | | | |
| 1.342 | ABB Ltd | 59.474 | 2,04 |
| Schweizer Franken insgesamt | | 59.474 | 2,04 |

Climate Innovation – Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------------------------------|--|----------------------|-----------------------------|
| Aktien 96,88 % (Fortsetzung) | | | |
| US-Dollar | | | |
| 65 | Adobe Inc | 38.779 | 1,33 |
| 178 | Applied Materials Inc | 28.848 | 0,99 |
| 324 | Autoliv Inc | 35.701 | 1,22 |
| 89 | Builders FirstSource Inc | 14.858 | 0,51 |
| 97 | Cadence Design Systems Inc | 26.420 | 0,90 |
| 322 | Clean Harbors Inc | 56.192 | 1,92 |
| 790 | Copart Inc | 38.710 | 1,32 |
| 96 | DR Horton Inc | 14.590 | 0,50 |
| 299 | Emerson Electric Co | 29.102 | 1,00 |
| 5.164 | GFL Environmental Inc | 178.210 | 6,10 |
| 3.130 | Green Plains Inc | 78.939 | 2,70 |
| 2.941 | Howmet Aerospace Inc | 159.167 | 5,45 |
| 1.250 | Ingersoll Rand Inc | 96.675 | 3,31 |
| 186 | ITT Inc | 22.193 | 0,76 |
| 1.101 | NEXTracker Inc Class A | 51.582 | 1,76 |
| 3.044 | nVent Electric Plc | 179.870 | 6,15 |
| 675 | ON Semiconductor Corp | 56.383 | 1,93 |
| 2.328 | Procure Technologies Inc | 161.144 | 5,51 |
| 735 | Quanta Services Inc | 158.613 | 5,43 |
| 1.936 | Sunnova Energy International Inc | 29.524 | 1,01 |
| 1.798 | Sunrun Inc | 35.295 | 1,21 |
| 49 | Synopsys Inc | 25.231 | 0,86 |
| 479 | Trane Technologies Plc | 116.828 | 4,00 |
| 221 | Union Pacific Corp | 54.282 | 1,86 |
| 271 | Veralto Corp | 22.292 | 0,76 |
| 504 | Wolfspeed Inc | 21.929 | 0,75 |
| 650 | Xylem Inc | 74.334 | 2,54 |
| | US-Dollar insgesamt | 1.805.691 | 61,78 |
| | Aktien insgesamt * | 2.831.398 | 96,88 |
| | Anlagen insgesamt | 2.831.398 | 96,88 |
| | | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
| | Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 2.831.398 | 96,88 |
| | Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | 2.831.398 | 96,88 |
| | Sonstiges Nettovermögen | 91.157 | 3,12 |
| | Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | 2.922.555 | 100,00 |

Climate Innovation – Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

| Portfolioanalyse | US\$ | % des Gesamtver- mögens |
|---|------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 2.831.398 | 95,75 |
| Anlagen insgesamt | 2.831.398 | 95,75 |

CLO Income - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|---|---|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Schatzwechsel 2,69 % (31. Dezember 2022: 0,00 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 09.01.2024 | 4.994.906 | 2,69 |
| Schatzwechsel insgesamt ** | | | | 4.994.906 | 2,69 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 86,02 % (31. Dezember 2022: 81,77 %) | | | | | |
| Euro | | | | | |
| 1.750.000 | Adagio X Eur CLO DAC Series X-X Class ER | 12,26 % | 20.10.2037 | 1.948.501 | 1,05 |
| 1.400.000 | Aqueduct European CLO 7-2022 DAC Series 2022-7X Class E | 11,12 % | 15.03.2036 | 1.565.014 | 0,84 |
| 1.000.000 | Arbour CLO VI DAC Series 6X Class E | 9,78 % | 15.11.2031 | 1.063.471 | 0,57 |
| 1.000.000 | Ares European CLO X DAC Series 10X Class F | 11,04 % | 15.10.2031 | 983.600 | 0,53 |
| 1.050.000 | Armada Euro CLO I DAC Series 1X Class ER | 10,06 % | 24.10.2033 | 1.132.849 | 0,61 |
| 1.500.000 | Armada Euro CLO V DAC Series 5X Class E | 9,92 % | 28.07.2034 | 1.583.171 | 0,85 |
| 3.000.000 | Aurium CLO III DAC Series 3X Class E | 8,87 % | 16.04.2030 | 3.166.148 | 1,71 |
| 1.200.000 | Aurium CLO VI DAC Series 6X Class ER | 10,00 % | 22.05.2034 | 1.269.687 | 0,68 |
| 1.500.000 | Avoca CLO XIII DAC Series 13X Class ERR | 10,16 % | 15.04.2034 | 1.590.619 | 0,86 |
| 1.400.000 | Avoca CLO XXVI Designated Activity Co Series 26X Class F | 13,06 % | 15.04.2035 | 1.440.736 | 0,78 |
| 1.500.000 | Avoca Static CLO I DAC Series 1X Class E | 10,97 % | 15.10.2030 | 1.656.443 | 0,89 |
| 3.100.000 | BlackRock European CLO XIV DAC Series 14X Class E | 11,61 % | 15.07.2036 | 3.410.638 | 1,84 |
| 1.000.000 | BlackRock European CLO XIV DAC Series 14X Class F | 14,16 % | 15.07.2036 | 1.116.044 | 0,60 |
| 1.000.000 | Contego CLO XII DAC Series 12X Class E | 11,97 % | 25.01.2038 | 1.102.536 | 0,59 |
| 1.700.000 | CVC Cordatus Loan Fund XXIII DAC Series 23X Class E | 11,22 % | 25.04.2036 | 1.871.805 | 1,01 |
| 1.500.000 | CVC Cordatus Loan Fund XXIII DAC Series 23X Class F | 13,32 % | 25.04.2036 | 1.569.368 | 0,84 |
| 2.250.000 | CVC Cordatus Loan Fund XXVI DAC Series 26X Class E | 12,36 % | 15.01.2037 | 2.531.838 | 1,36 |
| 1.400.000 | CVC Cordatus Loan Fund XXVII DAC Series 27X Class F | 14,32 % | 15.04.2035 | 1.565.290 | 0,84 |
| 3.000.000 | Euro-Galaxy VII CLO DAC Series 2019-7X Class ER | 10,16 % | 25.07.2035 | 3.159.758 | 1,70 |
| 1.500.000 | Goldentree Loan Management EUR CLO 3 DAC Series 3X Class E | 9,88 % | 20.01.2032 | 1.583.653 | 0,85 |
| 2.750.000 | Goldentree Loan Management EUR CLO 4 DAC Series 4X Class ER | 10,04 % | 20.07.2034 | 2.924.714 | 1,58 |
| 1.500.000 | Goldentree Loan Management EUR CLO 5 DAC Series 5X Class E | 9,22 % | 20.04.2034 | 1.551.385 | 0,84 |
| 1.000.000 | Margay CLO I DAC Series 1X Class E | 12,29 % | 15.07.2036 | 1.124.480 | 0,61 |
| 1.251.000 | OCP Euro CLO 2029-3 Ltd Series 2019-3X Class ER | 9,99 % | 20.04.2033 | 1.303.424 | 0,70 |
| 1.485.000 | Otranto Park CLO DAC Series 1X Class E | 11,05 % | 15.05.2035 | 1.600.289 | 0,86 |
| 1.150.000 | Otranto Park CLO DAC Series 1X Class F | 13,05 % | 15.05.2035 | 1.188.000 | 0,64 |
| 1.000.000 | Palmer Square European CLO 2022-1 DAC Series 2022-1X Class F | 12,85 % | 21.01.2035 | 1.015.725 | 0,55 |
| 2.000.000 | Palmer Square European Loan Funding 2023-1 DAC Series 2023-1X Class E | 10,53 % | 15.11.2032 | 2.154.184 | 1,16 |
| 1.650.000 | Vesey Park CLO DAC Series 1X Class E | 13,88 % | 16.11.2032 | 1.779.418 | 0,96 |
| 1.300.000 | Voya Euro CLO IV DAC Series 4X Class FR | 12,69 % | 15.10.2034 | 1.328.083 | 0,72 |
| Euro insgesamt | | | | 51.280.871 | 27,62 |

CLO Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 86,02 % (31. Dezember 2022: 81,77 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 2.000.000 | AB BSL CLO 1 Ltd Series 2020-1X Class ER | 12,17 % | 15.01.2035 | 1.970.196 | 1,06 |
| 1.000.000 | AB BSL CLO 3 Ltd Series 2021-3A Class E | 12,63 % | 20.10.2034 | 962.016 | 0,52 |
| 1.000.000 | AB BSL CLO 3 Ltd Series 2021-3X Class E | 12,53 % | 20.10.2034 | 962.016 | 0,52 |
| 2.500.000 | AB BSL CLO 4 Ltd Series 2023-4X Class E | 13,48 % | 20.04.2036 | 2.521.970 | 1,36 |
| 3.800.000 | AGL CLO 22 Ltd Series 2022-22X Class E | 13,95 % | 20.10.2035 | 3.824.500 | 2,06 |
| 1.000.000 | AGL CLO 25 Ltd Series 2023-25X Class E | 13,98 % | 21.07.2036 | 1.024.127 | 0,55 |
| 1.500.000 | Aimco CLO Series 2017-A Series 2017-AX Class FR | 14,12 % | 20.04.2034 | 1.192.705 | 0,64 |
| 2.000.000 | Apidos CLO XX Series 2015-20X Class DR | 11,28 % | 16.07.2031 | 1.883.186 | 1,01 |
| 2.100.000 | Apidos CLO XXIV Series 2016-24X Class DR | 11,38 % | 20.10.2030 | 1.986.467 | 1,07 |
| 3.000.000 | Apidos CLO XXXIV Series 2020-34X Class ER | 12,08 % | 20.01.2035 | 2.983.239 | 1,61 |
| 1.000.000 | Ares XLIX CLO Ltd Series 2018-49X Class E | 11,37 % | 22.07.2030 | 950.748 | 0,51 |
| 2.000.000 | Ares XXXVII CLO Ltd Series 2015-4X Class DR | 11,73 % | 15.10.2030 | 1.915.334 | 1,03 |
| 4.000.000 | Assurant CLO I Ltd Series 2018-2X Class E | 11,73 % | 20.10.2031 | 3.768.831 | 2,03 |
| 1.000.000 | Bain Capital Credit CLO 2023-2 Ltd Series 2023-2X Class E | 13,78 % | 18.07.2036 | 1.008.953 | 0,54 |
| 1.500.000 | Bain Capital Credit CLO 2023-4 Ltd Series 2023-4X Class E | 13,58 % | 21.10.2036 | 1.520.116 | 0,82 |
| 2.825.000 | Ballyrock CLO 2018-1 Ltd Series 2018-1X Class D | 11,38 % | 20.04.2031 | 2.679.606 | 1,44 |
| 3.000.000 | Bayswater Park CLO Ltd Series 2023-1X Class E | 12,74 % | 20.01.2037 | 2.984.526 | 1,61 |
| 2.200.000 | Benefit Street Partners CLO XXXIII Ltd Series 2023-33X Class E | 7,64 % | 25.01.2036 | 2.178.000 | 1,17 |
| 2.500.000 | Canyon Capital CLO 2023-1 Ltd Series 2023-1X Class E | 13,39 % | 15.10.2036 | 2.540.120 | 1,37 |
| 3.000.000 | Carlyle Global Market Strategies Series 2014-2RX Class D | 10,99 % | 15.05.2031 | 2.783.266 | 1,50 |
| 4.000.000 | Cific Funding 2018-I Ltd Series 2018-1X Class E | 10,56 % | 18.04.2031 | 3.734.563 | 2,01 |
| 3.000.000 | Dryden 60 CLO Ltd Series 2018-60X Class E | 11,18 % | 15.07.2031 | 2.858.506 | 1,54 |
| 2.135.000 | Dryden XXVIII Senior Loan Fund Series 2013-28X Class B2LR | 12,10 % | 15.08.2030 | 2.017.926 | 1,09 |
| 1.250.000 | Eaton Vance CLO 2015-1 Ltd Series 2015-1X Class ER | 11,18 % | 20.01.2030 | 1.128.097 | 0,61 |
| 2.000.000 | Eaton Vance CLO 2018-1 Ltd Series 2018-1X Class E | 11,58 % | 15.10.2030 | 1.882.433 | 1,01 |
| 4.000.000 | Galaxy XXV CLO Ltd Series 2018-25X Class E | 11,59 % | 25.10.2031 | 3.853.857 | 2,08 |
| 4.400.000 | Goldentree Loan Management US CLO 14 Ltd Series 2022-14X Class E | 13,15 % | 20.07.2035 | 4.433.084 | 2,39 |
| 3.000.000 | Goldentree Loan Management US CLO 18 Ltd Series 2023-18X Class E | 12,93 % | 20.01.2037 | 2.983.912 | 1,61 |
| 1.588.000 | Goldentree Loan Management US CLO 4 Ltd Series 2019-4X Class F | 12,06 % | 24.04.2031 | 1.278.367 | 0,69 |
| 1.400.000 | Goldentree Loan Management US CLO 5 Ltd Series 2019-5X Class F | 12,15 % | 20.10.2032 | 1.195.849 | 0,64 |
| 1.000.000 | Invesco US CLO 2023-1 Ltd Series 2023-1X Class E | 13,77 % | 22.04.2035 | 1.008.304 | 0,54 |
| 750.000 | KKR CLO 17 Ltd Series 17X Class E | 12,97 % | 15.04.2034 | 708.283 | 0,38 |
| 1.702.500 | Madison Park Funding XXX Ltd Series 2018-30X Class E | 10,53 % | 15.04.2029 | 1.636.041 | 0,88 |
| 3.300.000 | Magnetite CLO Ltd Series 2015-14RX Class E | 11,16 % | 18.10.2031 | 3.235.978 | 1,74 |
| 1.650.000 | Magnetite VII Ltd Series 2012-7X Class ER2 | 12,08 % | 15.01.2028 | 1.555.000 | 0,84 |
| 2.650.000 | Magnetite VIII Ltd Series 2014-8X Class FR2 | 13,02 % | 15.04.2031 | 2.366.416 | 1,28 |
| 2.490.000 | Magnetite XVII Ltd Series 2016-18X Class FR | 13,24 % | 15.11.2028 | 2.340.503 | 1,26 |

CLO Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|---------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 86,02 % (31. Dezember 2022: 81,77 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 2.000.000 | Mariner CLO 5 Ltd Series 2018-5X Class E | 11,29 % | 25.04.2031 | 1.874.987 | 1,01 |
| 1.500.000 | MidOcean Credit CLO XI Ltd Series 2022-11X Class ER | 13,68 % | 18.10.2033 | 1.468.342 | 0,79 |
| 1.500.000 | OCP CLO 2023-26 Ltd Series 2023-26X Class E | 13,57 % | 17.04.2036 | 1.505.465 | 0,81 |
| 2.000.000 | Post CLO 2018-1 Ltd Series 2018-1X Class E | 11,45 % | 16.04.2031 | 1.898.845 | 1,02 |
| 2.000.000 | PPM CLO 3 Ltd Series 2019-3X Class E | 12,19 % | 17.04.2034 | 1.880.042 | 1,01 |
| 2.200.000 | Symphony CLO 35 Ltd Series 2022-35X Class ER | 12,90 % | 24.10.2036 | 2.209.482 | 1,19 |
| 3.000.000 | Symphony CLO 37 Ltd Series 2022-37X Class ER | 13,31 % | 20.01.2037 | 2.986.379 | 1,61 |
| 2.000.000 | Symphony CLO 40 Ltd Series 2023-40X Class E | 13,13 % | 14.01.2034 | 2.020.192 | 1,09 |
| 4.000.000 | Trestles CLO II Ltd Series 2018-2X Class D | 11,39 % | 25.07.2031 | 3.874.372 | 2,09 |
| 1.000.000 | Trestles CLO Ltd Series 2021-18X Class E | 12,73 % | 20.01.2035 | 956.005 | 0,52 |
| 2.000.000 | Trinitas CLO VII Ltd Series 2017-7X Class ER | 12,74 % | 25.01.2035 | 1.860.981 | 1,00 |
| 1.675.000 | Trinitas CLO X Ltd Series 2019-10X Class ER | 12,68 % | 15.01.2035 | 1.447.718 | 0,78 |
| 1.000.000 | Trinitas CLO XVII Ltd Series 2021-17X Class E | 12,61 % | 20.10.2034 | 947.194 | 0,51 |
| 2.000.000 | Voya CLO 2022-3 Ltd Series 2022-3X Class ER | 13,42 % | 20.10.2036 | 2.013.667 | 1,09 |
| 1.600.000 | Wellington Management CLO 1 Ltd Series 2023-1X Class E | 13,05 % | 20.10.2036 | 1.605.492 | 0,87 |
| US-Dollar insgesamt | | | | 108.406.204 | 58,40 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt ** | | | | 159.687.075 | 86,02 |

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|---|---|--------------------|------------------------------|
| Investmentfonds 6,58 % (31. Dezember 2022: 0,00 %) | | | |
| US-Dollar | | | |
| 131.071 | iShares USD High Yield Corporate Bond UCITS ETF | 12.221.060 | 6,58 |
| Investmentfonds insgesamt # | | 12.221.060 | 6,58 |
| Anlagen insgesamt | | 176.903.041 | 95,29 |

Devisenterminkontrakte 1,26 % (31. Dezember 2022: 2,37 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeits- datum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettover- mögens |
|---------------------------------|------------------------|-----------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 1.017.894 € | 1.106.815 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 4 | 18.301 | 0,01 |
| 189.266 € | 200.264 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | 8.939 | 0,00 |
| 40.853.941 € | 43.731.412 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 12 | 1.425.985 | 0,77 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 383 £ | 470 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 18 | 0,00 |
| 7.222.743 £ | 8.871.789 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 336.571 | 0,18 |
| 7.223.098 £ | 8.864.237 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | 344.576 | 0,19 |
| 3.327 £ | 4.157 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 8 | 84 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i> | | | | | | |
| 15.085.883 SEK | 1.389.818 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 5 | 108.072 | 0,06 |
| 544.789 SEK | 52.779 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 3 | 1.314 | 0,00 |

CLO Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 1,26 % (31. Dezember 2022: 2,37 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|----------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen SEK (Fortsetzung)</i> | | | | | | |
| 166.133 SEK | 16.186 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | 309 | 0,00 |
| 14.531.738 SEK | 1.341.747 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | 101.120 | 0,05 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | 2.345.289 | 1,26 |

Total Return Swap-Kontrakte 0,03 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)

| Nominalwert | Datum der Schließung | Variabler Zinssatz | Referenzunternehmen | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens | |
|--|----------------------|--------------------|---------------------|--|----------------------|-------------|
| USD | 5.000.000 | 20.03.2024 | 5,38 ¹ | iBoxx USD Liquid High Yield Index ² | 48.732 | 0,03 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Total Return Swap-Kontrakten [∞] | | | | | 48.732 | 0,03 |

¹ Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist die USD Secured Overnight Financing Rate.

² Kontrahent für diese Total Return Swap-Kontrakte ist Goldman Sachs International.

| | | | | | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|--|--|--|--|--------------------|----------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | | | | | 179.297.062 | 96,58 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (1,38 %) (31. Dezember 2022: (0,72 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 34.818.167 US\$ | 32.901.543 € | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | (1.549.145) | (0,83) |
| 9.421.963 US\$ | 8.821.000 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 5 | (328.220) | (0,18) |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 245.213 € | 271.693 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (650) | (0,00) |
| 179.200 US\$ | 168.515 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (7.066) | (0,00) |
| 257.470 US\$ | 238.346 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 4 | (5.984) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 8.835.056 US\$ | 7.192.837 £ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | (335.177) | (0,18) |
| 8.827.086 US\$ | 7.192.837 £ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (343.147) | (0,19) |
| 372 US\$ | 304 £ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (16) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i> | | | | | | |
| 178.860 SEK | 17.936 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (177) | (0,00) |
| 13.638 US\$ | 149.159 SEK | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | (1.172) | (0,00) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | (2.570.754) | (1,38) |

| | | | | | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|---|--|--|--|--|--------------------|----------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | | | | | (2.570.754) | (1,38) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | | | | | 176.726.308 | 95,20 |
| Sonstiges Nettovermögen | | | | | 8.919.997 | 4,80 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | | | | | 185.646.305 | 100,00 |

CLO Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

| Portfolioanalyse | US\$ | % des Gesamtver- mögens |
|--|--------------------|-------------------------------|
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 164.681.981 | 84,21 |
| μ Investmentfonds | 12.221.060 | 6,25 |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente | (176.733) | (0,09) |
| Anlagen insgesamt | 176.726.308 | 90,37 |

Commodities - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Schatzwechsel 28,60 % (31. Dezember 2022: 45,88 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 9.000.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 16.01.2024 | 8.981.616 | 5,85 |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 23.01.2024 | 4.984.649 | 3,24 |
| 10.135.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 25.01.2024 | 10.100.891 | 6,57 |
| 10.000.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 01.02.2024 | 9.956.098 | 6,48 |
| 10.000.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 27.02.2024 | 9.917.907 | 6,46 |
| Schatzwechsel insgesamt ** | | | | 43.941.161 | 28,60 |
| Unternehmensanleihen 50,14 % (31. Dezember 2022: 30,49 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 1.240.000 | AbbVie Inc* | 2,60 % | 21.11.2024 | 1.211.975 | 0,79 |
| 1.545.000 | AbbVie Inc** | 3,85 % | 15.06.2024 | 1.533.263 | 1,00 |
| 2.845.000 | Amazon.com Inc** | 0,45 % | 12.05.2024 | 2.795.467 | 1,82 |
| 3.000.000 | American Express Co** | 6,34 % | 04.03.2025 | 3.007.534 | 1,96 |
| 2.299.000 | Amgen Inc** | 3,63 % | 22.05.2024 | 2.281.141 | 1,48 |
| 1.400.000 | Analog Devices Inc** | 5,69 % | 01.10.2024 | 1.400.192 | 0,91 |
| 2.945.000 | Apple Inc** | 3,00 % | 09.02.2024 | 2.936.451 | 1,91 |
| 3.711.000 | AT&T Inc* | 0,90 % | 25.03.2024 | 3.670.591 | 2,39 |
| 3.775.000 | Bank of America Corp** | 6,48 % | 25.04.2025 | 3.780.957 | 2,46 |
| 20.000 | Bank of New York Mellon Corp** | 5,58 % | 25.10.2024 | 19.966 | 0,01 |
| 1.390.000 | Bristol-Myers Squibb Co** | 2,90 % | 26.07.2024 | 1.371.592 | 0,89 |
| 330.000 | Capital One Financial Corp** | 6,75 % | 09.05.2025 | 329.870 | 0,21 |
| 545.000 | Caterpillar Financial Services Corp** | 5,65 % | 17.05.2024 | 544.968 | 0,35 |
| 1.605.000 | Caterpillar Financial Services Corp** | 5,69 % | 13.09.2024 | 1.605.149 | 1,05 |
| 880.000 | Citibank NA** | 3,65 % | 23.01.2024 | 879.054 | 0,57 |
| 145.000 | Citigroup Inc** | 6,78 % | 24.05.2025 | 145.384 | 0,09 |
| 2.915.000 | Citigroup Inc** | 6,96 % | 17.03.2026 | 2.935.681 | 1,91 |
| 2.000.000 | Corebridge Global Funding** | 0,65 % | 17.06.2024 | 1.953.099 | 1,27 |
| 40.000 | Enbridge Inc** | 6,03 % | 16.02.2024 | 40.012 | 0,03 |
| 3.397.000 | Enterprise Products Operating LLC* | 3,90 % | 15.02.2024 | 3.389.516 | 2,21 |
| 400.000 | Florida Power & Light Co** | 5,75 % | 12.01.2024 | 399.999 | 0,26 |
| 1.360.000 | General Motors Financial Co Inc* | 1,05 % | 08.03.2024 | 1.347.942 | 0,88 |
| 3.082.000 | Goldman Sachs Group Inc* | 5,70 % | 01.11.2024 | 3.091.203 | 2,01 |
| 1.175.000 | John Deere Capital Corp** | 5,56 % | 11.10.2024 | 1.175.145 | 0,77 |
| 10.000 | John Deere Capital Corp** | 5,97 % | 07.03.2025 | 10.034 | 0,01 |
| 3.938.000 | JPMorgan Chase & Co** | 6,01 % | 23.06.2025 | 3.931.456 | 2,56 |
| 765.000 | Microsoft Corp** | 2,88 % | 06.02.2024 | 763.146 | 0,50 |
| 3.665.000 | Morgan Stanley** | 6,01 % | 24.01.2025 | 3.660.147 | 2,38 |
| 2.075.000 | National Rural Utilities Cooperative Finance Corp** | 5,70 % | 18.10.2024 | 2.077.168 | 1,35 |
| 3.755.000 | Oracle Corp* | 3,40 % | 08.07.2024 | 3.712.126 | 2,42 |

Commodities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 50,14 % (31. Dezember 2022: 30,49 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 1.540.000 | PepsiCo Inc** | 5,80 % | 13.02.2026 | 1.540.214 | 1,00 |
| 2.000.000 | Protective Life Global Funding** | 6,42 % | 28.03.2025 | 2.007.679 | 1,31 |
| 1.729.000 | Royal Bank of Canada** | 5,82 % | 21.01.2025 | 1.724.635 | 1,12 |
| 2.095.000 | Simon Property Group LP* | 2,00 % | 13.09.2024 | 2.048.415 | 1,33 |
| 1.425.000 | Simon Property Group LP* | 3,75 % | 01.02.2024 | 1.422.651 | 0,93 |
| 55.000 | Starbucks Corp** | 5,82 % | 14.02.2024 | 55.000 | 0,04 |
| 1.185.000 | Toyota Motor Credit Corp** | 6,05 % | 22.03.2024 | 1.185.891 | 0,77 |
| 1.240.000 | Truist Bank** | 5,57 % | 17.01.2024 | 1.239.809 | 0,81 |
| 240.000 | Truist Financial Corp** | 5,82 % | 09.06.2025 | 236.478 | 0,15 |
| 2.415.000 | US Bancorp* | 2,40 % | 30.07.2024 | 2.374.249 | 1,55 |
| 1.565.000 | Verizon Communications Inc* | 0,75 % | 22.03.2024 | 1.548.374 | 1,01 |
| 2.000.000 | Volkswagen Group of America Finance LLC** | 6,37 % | 07.06.2024 | 2.002.945 | 1,30 |
| 3.650.000 | Wells Fargo & Co* | 3,75 % | 24.01.2024 | 3.645.228 | 2,37 |
| Unternehmensanleihen insgesamt | | | | 77.031.796 | 50,14 |
| Anlagen insgesamt | | | | 120.972.957 | 78,74 |

Devisenterminkontrakte 1,02 % (31. Dezember 2022: 1,77 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeits- datum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|------------------------|-----------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 30.117.998 £ | 36.992.612 US\$ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 4 | 1.405.179 | 0,91 |
| 2.213.057 £ | 2.779.018 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 7 | 42.435 | 0,03 |
| 3.901.557 £ | 4.848.536 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 60 | 125.607 | 0,08 |
| 247.634 US\$ | 194.104 £ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | 167 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ∞ | | | | | 1.573.388 | 1,02 |

Total Return Swap-Kontrakte 0,00 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)

| Nominalwert | Datum der Schließung | Variabler Zinssatz | Referenzunternehmen | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Netto- vermögens |
|---|-------------------------|--------------------|---|--------------------------------------|------------------------------|
| USD 150.965.727 | 28.03.2024 | 0,00 ¹ | Goldman Sachs i-Select Strategy 1168 Index ² | 0 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Total Return Swap-Kontrakten ∞ | | | | 0 | 0,00 |

¹ Fester Zinssatz.

² Die Gegenpartei für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist Goldman Sachs International.

| | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|--|--------------------|---------------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 122.546.345 | 79,76 |

Commodities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,14 %) (31. Dezember 2022: (0,39 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 321.032 £ | 409.785 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | (499) | (0,00) |
| 1.589.953 US\$ | 1.289.648 £ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 4 | (54.235) | (0,04) |
| 761.106 US\$ | 608.276 £ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 2 | (14.392) | (0,01) |
| 4.951.276 US\$ | 3.994.220 £ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 54 | (141.000) | (0,09) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | (210.126) | (0,14) |

Total Return Swap-Kontrakte (0,00 %) (31. Dezember 2022: (0,00 %))

| Nominalwert | Datum der Schließung | Variabler Zinssatz | Referenzunternehmen | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|----------------------|--------------------|---|---------------------------------|----------------------|
| USD 1.041.658 | 28.03.2024 | 0,00 ¹ | Goldman Sachs i-Select Strategy 1168 Index ² | (0) | (0,00) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Total Return Swap-Kontrakten [∞] | | | | (0) | (0,00) |

¹ Fester Zinssatz.

² Die Gegenpartei für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist Goldman Sachs International.

| | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|---|--------------------|----------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (210.126) | (0,14) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | 122.336.219 | 79,62 |
| Sonstiges Nettovermögen | 31.310.340 | 20,38 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | 153.646.559 | 100,00 |

| Portfolioanalyse | US\$ | % des Gesamtvermögens |
|---|--------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 27.462.270 | 16,71 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 93.510.687 | 56,90 |
| [∞] OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente | 1.363.262 | 0,83 |
| Anlagen insgesamt | 122.336.219 | 74,44 |

Corporate Hybrid Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert EUR | % des Netto- vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 93,25 % (31. Dezember 2022: 91,91 %) | | | | | |
| Euro | | | | | |
| 200.000 | Accor SA* | 7,25 % | 29.12.2049 | 218.094 | 0,01 |
| 37.000.000 | APA Infrastructure Ltd* | 7,13 % | 09.11.2083 | 38.946.718 | 2,08 |
| 700.000 | Arkema SA* | 1,50 % | 29.12.2049 | 650.352 | 0,03 |
| 2.500.000 | Arkema SA* | 2,75 % | 29.12.2049 | 2.477.875 | 0,13 |
| 48.104.000 | AusNet Services Holdings Pty Ltd* | 1,63 % | 11.03.2081 | 43.523.697 | 2,33 |
| 40.400.000 | Bayer AG* | 6,63 % | 25.09.2083 | 41.273.852 | 2,21 |
| 37.300.000 | Bayer AG* | 7,00 % | 25.09.2083 | 38.599.569 | 2,06 |
| 100.000 | Bertelsmann SE & Co KGaA* | 3,50 % | 23.04.2075 | 95.693 | 0,01 |
| 16.169.000 | BP Capital Markets Plc* | 3,25 % | 29.12.2049 | 15.655.473 | 0,84 |
| 49.080.000 | BP Capital Markets Plc* | 3,63 % | 29.12.2049 | 46.093.089 | 2,47 |
| 5.194.000 | British Telecommunications Plc* | 1,87 % | 18.08.2080 | 4.968.321 | 0,27 |
| 100.000 | EDP - Energias de Portugal SA* | 1,88 % | 14.03.2082 | 84.532 | 0,00 |
| 15.000.000 | Electricite de France SA* | 7,50 % | 29.12.2049 | 16.413.120 | 0,88 |
| 44.500.000 | Elia Group SA* | 5,85 % | 29.12.2049 | 45.337.490 | 2,42 |
| 41.500.000 | ELM BV for Firmenich International SA* | 3,75 % | 29.12.2049 | 40.771.675 | 2,18 |
| 20.600.000 | EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG* | 1,38 % | 31.08.2081 | 17.630.201 | 0,94 |
| 17.700.000 | EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG* | 1,88 % | 29.06.2080 | 16.564.899 | 0,89 |
| 10.200.000 | Enel SpA* | 1,38 % | 29.12.2049 | 8.937.240 | 0,48 |
| 21.600.000 | Enel SpA* | 6,38 % | 29.12.2049 | 22.644.079 | 1,21 |
| 3.100.000 | Engie SA* | 1,63 % | 29.12.2049 | 2.987.749 | 0,16 |
| 100.000 | Eni SpA* | 3,38 % | 29.12.2049 | 92.003 | 0,00 |
| 100.000 | Evonik Industries AG* | 1,38 % | 02.09.2081 | 88.915 | 0,00 |
| 36.371.000 | Heimstaden Bostad AB* | 2,63 % | 29.12.2049 | 12.736.760 | 0,68 |
| 16.860.000 | Heimstaden Bostad AB* | 3,25 % | 29.12.2049 | 8.838.855 | 0,47 |
| 6.714.000 | Heimstaden Bostad AB* | 3,38 % | 29.12.2049 | 2.851.033 | 0,15 |
| 20.500.000 | Iberdrola Finanzas SA* | 4,88 % | 29.12.2049 | 20.716.787 | 1,11 |
| 20.000.000 | Iberdrola International BV* | 1,45 % | 29.12.2049 | 18.235.500 | 0,98 |
| 8.900.000 | Iberdrola International BV* | 1,87 % | 29.12.2049 | 8.400.844 | 0,45 |
| 100.000 | Infineon Technologies AG* | 3,63 % | 29.12.2049 | 96.270 | 0,01 |
| 32.166.000 | Koninklijke FrieslandCampina NV* | 2,85 % | 29.12.2049 | 29.724.697 | 1,59 |
| 3.600.000 | Orange SA* | 2,38 % | 29.12.2049 | 3.507.768 | 0,19 |
| 10.940.000 | Orange SA* | 5,00 % | 29.12.2049 | 11.192.878 | 0,60 |
| 3.000.000 | Orange SA* | 5,25 % | 29.12.2049 | 3.005.625 | 0,16 |
| 20.000.000 | Orange SA* | 5,38 % | 29.12.2049 | 20.982.880 | 1,12 |
| 9.854.000 | Orsted AS* | 1,75 % | 29.12.2049 | 8.662.149 | 0,46 |
| 25.000.000 | Orsted AS* | 5,25 % | 29.12.2049 | 25.074.600 | 1,34 |
| 100.000 | Redeia Corp SA* | 4,63 % | 29.12.2049 | 102.014 | 0,01 |
| 10.000.000 | Repsol International Finance BV* | 3,75 % | 29.12.2049 | 9.812.500 | 0,52 |

Corporate Hybrid Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert EUR | % des Nettover- mögens |
|--|--------------------------------------|--------|-----------------------|----------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 93,25 % (31. Dezember 2022: 91,91 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Euro (Fortsetzung) | | | | | |
| 94.973.000 | Southern Co* | 1,88 % | 15.09.2081 | 81.689.340 | 4,37 |
| 19.358.000 | SSE Plc* | 3,13 % | 29.12.2049 | 18.415.072 | 0,98 |
| 36.405.000 | SSE Plc* | 4,00 % | 29.12.2049 | 35.369.096 | 1,89 |
| 19.875.000 | Stedin Holding NV* | 1,50 % | 29.12.2049 | 17.899.306 | 0,96 |
| 100.000 | Syensqo SA* | 2,50 % | 29.12.2049 | 95.152 | 0,01 |
| 10.000.000 | Telefonica Europe BV* | 6,75 % | 29.12.2049 | 10.702.370 | 0,57 |
| 15.000.000 | Telefonica Europe BV* | 7,13 % | 29.12.2049 | 16.228.725 | 0,87 |
| 9.185.000 | Telia Co AB* | 1,38 % | 11.05.2081 | 8.553.531 | 0,46 |
| 100.000 | Terna - Rete Elettrica Nazionale* | 2,38 % | 29.12.2049 | 89.803 | 0,00 |
| 30.944.000 | TotalEnergies SE* | 1,63 % | 29.12.2049 | 27.761.750 | 1,48 |
| 12.045.000 | TotalEnergies SE* | 2,63 % | 29.12.2049 | 11.789.044 | 0,63 |
| 45.000.000 | Unibail-Rodamco-Westfield SE* | 7,25 % | 29.12.2049 | 45.164.033 | 2,42 |
| 26.500.000 | Veolia Environnement SA* | 2,00 % | 29.12.2049 | 23.780.438 | 1,27 |
| 48.800.000 | Veolia Environnement SA* | 2,25 % | 29.12.2049 | 46.206.719 | 2,47 |
| 30.100.000 | Veolia Environnement SA* | 5,99 % | 29.12.2049 | 31.699.273 | 1,70 |
| 38.000.000 | Vodafone Group Plc* | 6,50 % | 30.08.2084 | 40.727.906 | 2,18 |
| 83.700.000 | Volkswagen International Finance NV* | 7,50 % | 29.12.2049 | 91.213.498 | 4,88 |
| Euro insgesamt | | | | 1.095.380.852 | 58,58 |
| Britisches Pfund | | | | | |
| 23.993.000 | BP Capital Markets Plc* | 4,25 % | 29.12.2049 | 26.068.594 | 1,40 |
| 46.600.000 | British Telecommunications Plc* | 8,38 % | 20.12.2083 | 56.919.528 | 3,04 |
| 62.536.000 | Centrica Plc* | 5,25 % | 10.04.2075 | 71.449.200 | 3,82 |
| 76.600.000 | Electricite de France SA* | 6,00 % | 29.12.2049 | 86.297.261 | 4,62 |
| 100.000 | Mobico Group Plc* | 4,25 % | 29.12.2049 | 102.179 | 0,01 |
| 108.587.000 | NGG Finance Plc* | 5,63 % | 18.06.2073 | 123.874.260 | 6,63 |
| 3.500.000 | Orsted AS* | 2,50 % | 29.12.2049 | 2.689.706 | 0,14 |
| 23.597.000 | SSE Plc* | 3,74 % | 29.12.2049 | 25.672.138 | 1,37 |
| 32.500.000 | Vattenfall AB* | 6,88 % | 17.08.2083 | 37.800.197 | 2,02 |
| Britisches Pfund insgesamt | | | | 430.873.063 | 23,05 |
| US-Dollar | | | | | |
| 48.750.000 | British Telecommunications Plc* | 4,25 % | 23.11.2081 | 40.820.536 | 2,18 |
| 66.590.000 | Enbridge Inc** | 5,50 % | 15.07.2077 | 55.206.067 | 2,95 |
| 20.000.000 | Enbridge Inc** | 8,25 % | 15.01.2084 | 18.726.782 | 1,00 |
| 19.500.000 | PPL Capital Funding Inc* | 8,27 % | 30.03.2067 | 16.480.276 | 0,88 |
| 12.455.000 | Rogers Communications Inc** | 5,25 % | 15.03.2082 | 10.848.784 | 0,58 |

Corporate Hybrid Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert EUR | % des Netto- vermögens |
|--|-----------------------|--------|-----------------------|----------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 93,25 % (31. Dezember 2022: 91,91 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 2.000.000 | Vodafone Group Plc** | 3,25 % | 04.06.2081 | 1.668.853 | 0,09 |
| 81.487.000 | Vodafone Group Plc* | 6,25 % | 03.10.2078 | 73.578.412 | 3,94 |
| US-Dollar insgesamt | | | | 217.329.710 | 11,62 |
| Unternehmensanleihen insgesamt | | | | 1.743.583.625 | 93,25 |

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert EUR | % des Nettover- mögens |
|---|--|-----------------|------------------------------|
| Investmentfonds 0,59 % (31. Dezember 2022: 0,58 %) | | | |
| US-Dollar | | | |
| 1.300.000 | Neuberger Berman Global Investment Grade Credit Fund | 10.956.412 | 0,59 |
| Investmentfonds insgesamt ¹⁾ | | | 10.956.412 |
| Anlagen insgesamt | | | 1.754.540.037 |

Devisenterminkontrakte 0,64 % (31. Dezember 2022: 2,05 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeits- datum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn EUR | % des Nettover- mögens |
|--|------------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------|-------------------------------------|------------------------------|
| 6.407.281 € | 5.526.226 £ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | 33.258 | 0,00 |
| 11.192.060 € | 12.066.657 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 5 | 275.347 | 0,02 |
| 1.895.251 € | 1.627.710 £ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 17.829 | 0,00 |
| 291.260.860 € | 310.288.338 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 4 | 10.542.800 | 0,56 |
| 22.477.139 £ | 25.906.424 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 19.004 | 0,00 |
| 14.496.290 US\$ | 13.100.000 € | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | 14.803 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> | | | | | | |
| 191.185 AUD | 115.925 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 5 | 2.159 | 0,00 |
| 5.145.727 AUD | 3.107.269 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | 70.957 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> | | | | | | |
| 144.858 CHF | 152.593 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | 3.371 | 0,00 |
| 34.799 CHF | 36.940 € | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | 527 | 0,00 |
| 11.164.379 CHF | 11.738.048 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 6 | 282.274 | 0,02 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 122.047 € | 105.157 £ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 27 | 758 | 0,00 |
| 16.094.136 £ | 18.548.632 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 4 | 14.556 | 0,00 |
| 417.717 £ | 479.601 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 16 | 2.200 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i> | | | | | | |
| 3.738 € | 5.434 SGD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | 9 | 0,00 |
| 21.255 SGD | 14.540 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | 49 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen USD</i> | | | | | | |
| 1.488.862 € | 1.631.501 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 12.842 | 0,00 |
| 16.115.313 € | 17.165.198 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | 585.947 | 0,03 |
| 10.525.674 € | 11.388.561 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 60 | 222.436 | 0,01 |
| 10.533 US\$ | 9.479 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 50 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ²⁾ | | | | | 12.101.176 | 0,64 |

Corporate Hybrid Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| | Zeitwert EUR | % des Nettover- mögens |
|--|----------------------|------------------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 1.766.641.213 | 94,48 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,41 %) (31. Dezember 2022: (1,14 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust EUR | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 492.808.467 € | 427.618.156 £ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 5 | (411.950) | (0,02) |
| 2.127.209 € | 1.850.257 £ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (6.902) | (0,00) |
| 4.916.255 US\$ | 4.500.000 € | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (52.261) | (0,00) |
| 4.368.416 US\$ | 4.064.684 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | (112.575) | (0,01) |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> | | | | | | |
| 155.164 € | 253.240 AUD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | (1.247) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> | | | | | | |
| 52.458 € | 49.263 CHF | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (582) | (0,00) |
| 5.170.860 € | 4.918.726 CHF | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 12 | (124.972) | (0,01) |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 4.512.164 € | 3.915.408 £ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (3.919) | (0,00) |
| 586.121 € | 511.172 £ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 55 | (3.473) | (0,00) |
| 209.165 £ | 243.689 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | (2.435) | (0,00) |
| 115.911 £ | 134.851 € | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (1.157) | (0,00) |
| 150.292 £ | 174.953 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 7 | (1.604) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i> | | | | | | |
| 7.303 € | 10.642 SGD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (1) | (0,00) |
| 1.656.782 SGD | 1.148.107 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | (10.976) | (0,00) |
| 90.089 SGD | 62.329 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 8 | (497) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen USD</i> | | | | | | |
| 309.606 € | 344.111 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | (1.712) | (0,00) |
| 10.954.404 US\$ | 10.140.044 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 9 | (229.588) | (0,01) |
| 196.305.169 US\$ | 184.298.441 € | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | (6.701.029) | (0,36) |
| 2.234.565 US\$ | 2.086.860 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 26 | (65.250) | (0,00) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ^{oo} | | | | | (7.732.130) | (0,41) |

| | Zeitwert EUR | % des Nettover- mögens |
|---|----------------------|------------------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (7.732.130) | (0,41) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | 1.758.909.083 | 94,07 |
| Sonstiges Nettovermögen | 110.907.380 | 5,93 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | 1.869.816.463 | 100,00 |

Corporate Hybrid Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

| Portfolioanalyse | EUR | % des Gesamtver- mögens |
|---|----------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 1.657.133.139 | 87,97 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 86.450.486 | 4,59 |
| μ Investmentfonds | 10.956.412 | 0,58 |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente | 4.369.046 | 0,23 |
| Anlagen insgesamt | 1.758.909.083 | 93,37 |

Developed Market FMP - 2027 - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|-------------------------------------|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 98,78 % | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 3.650.000 | AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust* | 2,45 % | 29.10.2026 | 3.381.224 | 2,46 |
| 3.600.000 | Air Lease Corp* | 3,63 % | 01.04.2027 | 3.407.834 | 2,48 |
| 560.000 | Ally Financial Inc* | 5,75 % | 20.11.2025 | 556.939 | 0,41 |
| 1.295.833 | American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd** | 5,50 % | 20.04.2026 | 1.287.461 | 0,94 |
| 2.800.000 | American Tower Corp* | 3,65 % | 15.03.2027 | 2.694.987 | 1,96 |
| 1.285.000 | Amsted Industries Inc** | 5,63 % | 01.07.2027 | 1.281.696 | 0,93 |
| 915.000 | APX Group Inc** | 6,75 % | 15.02.2027 | 914.003 | 0,67 |
| 1.200.000 | Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp** | 7,00 % | 01.11.2026 | 1.210.230 | 0,88 |
| 1.000.000 | AT&T Inc** | 3,80 % | 15.02.2027 | 976.399 | 0,71 |
| 2.795.000 | Bank of America Corp* | 4,25 % | 22.10.2026 | 2.745.735 | 2,00 |
| 1.750.000 | BAT Capital Corp* | 4,70 % | 02.04.2027 | 1.733.286 | 1,26 |
| 355.000 | Bath & Body Works Inc* | 6,69 % | 15.01.2027 | 363.134 | 0,26 |
| 440.000 | Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp** | 7,63 % | 15.12.2025 | 446.183 | 0,32 |
| 3.000.000 | BNP Paribas SA** | 1,68 % | 30.06.2027 | 2.749.236 | 2,00 |
| 2.100.000 | Boeing Co* | 5,04 % | 01.05.2027 | 2.119.452 | 1,54 |
| 3.500.000 | BPCE SA** | 4,88 % | 01.04.2026 | 3.431.618 | 2,50 |
| 1.475.000 | Broadcom Inc** | 3,46 % | 15.09.2026 | 1.426.946 | 1,04 |
| 580.000 | Buckeye Partners LP** | 3,95 % | 01.12.2026 | 548.590 | 0,40 |
| 3.600.000 | Capital One Financial Corp* | 3,65 % | 11.05.2027 | 3.434.116 | 2,50 |
| 920.000 | Carnival Corp** | 7,63 % | 01.03.2026 | 937.209 | 0,68 |
| 1.700.000 | Carrier Global Corp** | 2,49 % | 15.02.2027 | 1.599.245 | 1,16 |
| 1.225.000 | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp** | 5,13 % | 01.05.2027 | 1.182.914 | 0,86 |
| 700.000 | CNH Industrial Capital LLC* | 1,45 % | 15.07.2026 | 642.318 | 0,47 |
| 910.000 | Corebridge Financial Inc** | 3,65 % | 05.04.2027 | 875.905 | 0,64 |
| 705.000 | Coty Inc** | 6,50 % | 15.04.2026 | 704.828 | 0,51 |
| 2.215.000 | Crown Castle Inc* | 2,90 % | 15.03.2027 | 2.072.882 | 1,51 |
| 630.000 | CSC Holdings LLC** | 5,50 % | 15.04.2027 | 582.729 | 0,42 |
| 2.125.000 | Dell International LLC/EMC Corp** | 4,90 % | 01.10.2026 | 2.129.182 | 1,55 |
| 2.650.000 | Energy Transfer LP* | 4,20 % | 15.04.2027 | 2.576.641 | 1,87 |
| 835.000 | Energy Transfer LP** | 5,63 % | 01.05.2027 | 832.704 | 0,61 |
| 1.255.000 | EQM Midstream Partners LP** | 7,50 % | 01.06.2027 | 1.291.763 | 0,94 |
| 3.175.000 | Ford Motor Credit Co LLC* | 6,95 % | 10.06.2026 | 3.258.984 | 2,37 |
| 3.250.000 | General Motors Financial Co Inc* | 5,00 % | 09.04.2027 | 3.244.667 | 2,36 |
| 560.000 | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp* | 8,00 % | 15.01.2027 | 569.691 | 0,41 |
| 3.000.000 | Global Payments Inc* | 2,15 % | 15.01.2027 | 2.763.490 | 2,01 |
| 2.650.000 | HCA Inc* | 4,50 % | 15.02.2027 | 2.620.351 | 1,91 |
| 1.725.000 | Hess Corp* | 4,30 % | 01.04.2027 | 1.708.050 | 1,24 |

Developed Market FMP - 2027 - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|---|--|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 98,78 % (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 1.850.000 | HP Inc* | 3,00 % | 17.06.2027 | 1.750.415 | 1,27 |
| 3.600.000 | HSBC Holdings Plc* | 1,59 % | 24.05.2027 | 3.303.441 | 2,40 |
| 3.000.000 | Imperial Brands Finance Plc* | 6,13 % | 27.07.2027 | 3.082.517 | 2,24 |
| 860.000 | Legends Hospitality Holding Co LLC/Legends Hospitality Co-Issuer Inc** | 5,00 % | 01.02.2026 | 859.247 | 0,63 |
| 3.250.000 | Lloyds Banking Group Plc* | 3,75 % | 11.01.2027 | 3.121.927 | 2,27 |
| 1.070.000 | Mauser Packaging Solutions Holding Co** | 7,88 % | 15.08.2026 | 1.089.789 | 0,79 |
| 3.300.000 | Micron Technology Inc** | 4,19 % | 15.02.2027 | 3.238.419 | 2,36 |
| 3.400.000 | Morgan Stanley* | 3,95 % | 23.04.2027 | 3.302.459 | 2,40 |
| 2.075.000 | MPLX LP* | 4,13 % | 01.03.2027 | 2.032.764 | 1,48 |
| 3.300.000 | Nationwide Building Society* | 4,00 % | 14.09.2026 | 3.170.006 | 2,31 |
| 2.675.000 | NatWest Group Plc* | 1,64 % | 14.06.2027 | 2.444.545 | 1,78 |
| 1.465.000 | New Fortress Energy Inc** | 6,75 % | 15.09.2025 | 1.453.818 | 1,06 |
| 1.100.000 | NiSource Inc* | 3,49 % | 15.05.2027 | 1.059.911 | 0,77 |
| 1.010.000 | NOVA Chemicals Corp** | 5,25 % | 01.06.2027 | 948.126 | 0,69 |
| 925.000 | NRG Energy Inc* | 6,63 % | 15.01.2027 | 927.637 | 0,67 |
| 725.000 | OneMain Finance Corp** | 7,13 % | 15.03.2026 | 739.111 | 0,54 |
| 1.400.000 | Oracle Corp* | 2,80 % | 01.04.2027 | 1.321.236 | 0,96 |
| 3.400.000 | Paramount Global** | 2,90 % | 15.01.2027 | 3.148.529 | 2,29 |
| 1.675.000 | Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer** | 7,50 % | 01.06.2025 | 1.685.535 | 1,23 |
| 1.635.000 | Penn Entertainment Inc** | 5,63 % | 15.01.2027 | 1.587.890 | 1,16 |
| 2.650.000 | Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp** | 4,50 % | 15.12.2026 | 2.617.387 | 1,90 |
| 2.970.000 | Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc** | 5,75 % | 15.04.2026 | 2.984.615 | 2,17 |
| 2.775.000 | Rogers Communications Inc** | 3,20 % | 15.03.2027 | 2.649.784 | 1,93 |
| 1.035.000 | Royal Caribbean Cruises Ltd** | 5,50 % | 31.08.2026 | 1.025.450 | 0,75 |
| 3.800.000 | Santander UK Group Holdings Plc* | 1,67 % | 14.06.2027 | 3.457.077 | 2,52 |
| 800.000 | Sempra* | 3,25 % | 15.06.2027 | 758.738 | 0,55 |
| 3.000.000 | Stellantis Finance US Inc** | 1,71 % | 29.01.2027 | 2.725.842 | 1,98 |
| 955.000 | TK Elevator US Newco Inc** | 5,25 % | 15.07.2027 | 939.107 | 0,68 |
| 1.250.000 | T-Mobile USA Inc** | 3,75 % | 15.04.2027 | 1.212.785 | 0,88 |
| 960.000 | TransDigm Inc* | 7,50 % | 15.03.2027 | 965.463 | 0,70 |
| 3.200.000 | UBS Group AG* | 4,55 % | 17.04.2026 | 3.159.572 | 2,30 |
| 3.500.000 | Viatis Inc** | 2,30 % | 22.06.2027 | 3.175.885 | 2,31 |
| 1.640.000 | Vistra Operations Co LLC** | 5,63 % | 15.02.2027 | 1.618.665 | 1,18 |
| 3.080.000 | Warnermedia Holdings Inc** | 3,76 % | 15.03.2027 | 2.952.304 | 2,15 |
| 1.000.000 | Williams Cos Inc* | 3,75 % | 15.06.2027 | 964.568 | 0,70 |
| Unternehmensanleihen insgesamt | | | | 135.777.186 | 98,78 |
| Anlagen insgesamt | | | | 135.777.186 | 98,78 |

Developed Market FMP - 2027 - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 0,03 %

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|-----------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 8.274 € | 9.001 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 145 | 0,00 |
| 492.259 € | 524.041 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 2 | 20.072 | 0,02 |
| 504.986 € | 538.555 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 5 | 19.624 | 0,01 |
| 5.676 € | 6.246 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 28 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | 39.869 | 0,03 |
| | | | | | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | | | | | 135.817.055 | 98,81 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,00 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|-----------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 7.797 € | 8.639 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (21) | (0,00) |
| 8.150 US\$ | 7.710 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (372) | (0,00) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | (393) | (0,00) |
| | | | | | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | | | | | (393) | (0,00) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | | | | | 135.816.662 | 98,81 |
| Sonstiges Nettovermögen | | | | | 1.641.157 | 1,19 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | | | | | 137.457.819 | 100,00 |

| Portfolioanalyse | | US\$ | % des Gesamtvermögens |
|--------------------------|---|--------------------|-----------------------|
| * | Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 74.716.057 | 54,22 |
| ** | Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 61.061.129 | 44,31 |
| ∞ | OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente | 39.476 | 0,03 |
| Anlagen insgesamt | | 135.816.662 | 98,56 |

Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 27,64 % (31. Dezember 2022: 31,50 %) | | | | | |
| Euro | | | | | |
| 700.000 | Banque Ouest Africaine de Developpement* | 2,75 % | 22.01.2033 | 595.501 | 0,02 |
| 6.921.000 | NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance Plc* | 7,13 % | 19.07.2026 | 3.629.445 | 0,14 |
| 20.129.000 | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara* | 1,88 % | 05.11.2031 | 18.126.824 | 0,68 |
| Euro insgesamt | | | | 22.351.770 | 0,84 |
| US-Dollar | | | | | |
| 2.072.000 | Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC* | 3,65 % | 02.11.2029 | 1.970.990 | 0,07 |
| 21.827.000 | Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC* | 4,60 % | 02.11.2047 | 20.087.999 | 0,76 |
| 3.684.000 | Abu Dhabi National Energy Co PJSC* | 4,70 % | 24.04.2033 | 3.739.168 | 0,14 |
| 4.527.000 | Abu Dhabi Ports Co PJSC* | 2,50 % | 06.05.2031 | 3.862.233 | 0,15 |
| 6.565.000 | Adani Electricity Mumbai Ltd** | 3,95 % | 12.02.2030 | 5.383.428 | 0,20 |
| 5.990.000 | Adani Green Energy UP Ltd/Prayatna Developers Pvt Ltd/Parampujya Solar Energ* | 6,25 % | 10.12.2024 | 5.926.486 | 0,22 |
| 5.620.000 | Aeropuerto Internacional de Tocumen SA** | 5,13 % | 11.08.2061 | 4.286.514 | 0,16 |
| 3.195.000 | African Export-Import Bank* | 3,80 % | 17.05.2031 | 2.717.242 | 0,10 |
| 3.973.057 | Alfa Desarrollo SpA** | 4,55 % | 27.09.2051 | 3.105.655 | 0,12 |
| 2.556.000 | Alibaba Group Holding Ltd* | 3,25 % | 09.02.2061 | 1.609.471 | 0,06 |
| 1.528.000 | AngloGold Ashanti Holdings Plc* | 3,75 % | 01.10.2030 | 1.329.617 | 0,05 |
| 3.283.000 | Banco Nacional de Panama* | 2,50 % | 11.08.2030 | 2.439.876 | 0,09 |
| 3.143.000 | Bank Leumi Le-Israel BM** | 3,28 % | 29.01.2031 | 2.848.972 | 0,11 |
| 16.866.000 | Banque Ouest Africaine de Developpement* | 4,70 % | 22.10.2031 | 14.413.515 | 0,54 |
| 12.145.000 | Banque Ouest Africaine de Developpement* | 5,00 % | 27.07.2027 | 11.338.876 | 0,43 |
| 5.905.000 | Bidvest Group UK Plc* | 3,63 % | 23.09.2026 | 5.491.650 | 0,21 |
| 9.867.939 | Bioceanico Sovereign Certificate Ltd* | 0,00 % | 05.06.2034 | 7.070.462 | 0,27 |
| 6.668.500 | Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais** | 5,33 % | 15.02.2028 | 6.570.673 | 0,25 |
| 3.254.000 | Cemex SAB de CV** | 5,13 % | 29.12.2049 | 3.088.636 | 0,12 |
| 7.156.000 | Cemex SAB de CV** | 9,13 % | 29.12.2049 | 7.629.937 | 0,29 |
| 4.626.000 | Cencosud SA* | 4,38 % | 17.07.2027 | 4.466.244 | 0,17 |
| 227.000 | China Huadian Overseas Development Management Co Ltd* | 4,00 % | 29.12.2049 | 225.102 | 0,01 |
| 9.282.000 | Comision Federal de Electricidad* | 3,35 % | 09.02.2031 | 7.762.482 | 0,29 |
| 8.419.000 | Comision Federal de Electricidad* | 4,69 % | 15.05.2029 | 7.932.194 | 0,30 |
| 6.388.000 | Comision Federal de Electricidad* | 6,26 % | 15.02.2052 | 5.612.023 | 0,21 |
| 2.193.000 | Corp Nacional del Cobre de Chile* | 3,00 % | 30.09.2029 | 1.958.357 | 0,07 |
| 6.749.000 | Corp Nacional del Cobre de Chile* | 3,15 % | 14.01.2030 | 6.034.908 | 0,23 |
| 5.844.000 | Corp Nacional del Cobre de Chile* | 3,70 % | 30.01.2050 | 4.229.787 | 0,16 |
| 1.373.000 | Corp Nacional del Cobre de Chile* | 4,38 % | 05.02.2049 | 1.116.085 | 0,04 |
| 150.000 | Corp Nacional del Cobre de Chile* | 6,15 % | 24.10.2036 | 154.031 | 0,01 |
| 3.594.000 | Corp. Nacional del Cobre de Chile* | 5,13 % | 02.02.2033 | 3.488.904 | 0,13 |
| 4.505.000 | Corp. Nacional del Cobre de Chile* | 5,95 % | 08.01.2034 | 4.578.747 | 0,17 |
| 2.616.000 | CSN Inova Ventures** | 6,75 % | 28.01.2028 | 2.557.953 | 0,10 |

Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 27,64 % (31. Dezember 2022: 31,50 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 10.306.000 | CSN Resources SA** | 4,63 % | 10.06.2031 | 8.437.047 | 0,32 |
| 4.989.000 | CSN Resources SA** | 8,88 % | 05.12.2030 | 5.203.627 | 0,20 |
| 2.934.000 | CT Trust** | 5,13 % | 03.02.2032 | 2.567.417 | 0,10 |
| 3.314.000 | DP World Crescent Ltd* | 3,88 % | 18.07.2029 | 3.145.801 | 0,12 |
| 7.200.000 | DP World Ltd* | 6,85 % | 02.07.2037 | 7.965.043 | 0,30 |
| 5.914.000 | Eastern & Southern African Trade & Development Bank* | 4,13 % | 30.06.2028 | 5.124.481 | 0,19 |
| 6.636.000 | Eastern & Southern African Trade & Development Bank* | 4,88 % | 23.05.2024 | 6.566.123 | 0,25 |
| 5.626.000 | Ecopetrol SA* | 5,88 % | 02.11.2051 | 4.263.017 | 0,16 |
| 5.120.000 | Ecopetrol SA** | 6,88 % | 29.04.2030 | 5.079.994 | 0,19 |
| 5.395.000 | Ecopetrol SA* | 8,88 % | 13.01.2033 | 5.867.904 | 0,22 |
| 5.783.000 | Empresa de Transmision Electrica SA* | 5,13 % | 02.05.2049 | 4.203.345 | 0,16 |
| 5.719.000 | Empresa Nacional del Petroleo** | 3,45 % | 16.09.2031 | 4.826.303 | 0,18 |
| 3.031.000 | Empresa Nacional del Petroleo** | 4,50 % | 14.09.2047 | 2.292.042 | 0,09 |
| 1.340.000 | Empresa Nacional del Petroleo* | 4,50 % | 14.09.2047 | 1.013.390 | 0,04 |
| 5.830.000 | Empresa Nacional del Petroleo* | 5,25 % | 06.11.2029 | 5.656.609 | 0,21 |
| 1.814.000 | Empresa Nacional del Petroleo* | 6,15 % | 10.05.2033 | 1.821.994 | 0,07 |
| 4.395.003 | Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd** | 2,16 % | 31.03.2034 | 3.824.581 | 0,14 |
| 8.304.000 | Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd* | 2,63 % | 31.03.2036 | 6.868.124 | 0,26 |
| 9.747.372 | Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd* | 2,94 % | 30.09.2040 | 8.037.918 | 0,30 |
| 5.445.000 | Greenko Power II Ltd* | 4,30 % | 13.12.2028 | 4.922.280 | 0,19 |
| 9.182.000 | Grupo Aval Ltd* | 4,38 % | 04.02.2030 | 7.806.527 | 0,29 |
| 1.685.000 | IHS Netherlands Holdco BV** | 8,00 % | 18.09.2027 | 1.506.323 | 0,06 |
| 2.633.000 | Kallpa Generacion SA* | 4,13 % | 16.08.2027 | 2.518.752 | 0,10 |
| 7.140.000 | KazMunayGas National Co JSC* | 3,50 % | 14.04.2033 | 5.951.733 | 0,22 |
| 31.427.000 | KazMunayGas National Co JSC* | 5,38 % | 24.04.2030 | 31.233.034 | 1,18 |
| 15.847.000 | KazMunayGas National Co JSC* | 5,75 % | 19.04.2047 | 13.930.654 | 0,53 |
| 12.734.000 | KazMunayGas National Co JSC* | 6,38 % | 24.10.2048 | 11.988.237 | 0,45 |
| 2.026.000 | Khazanah Capital Ltd* | 4,88 % | 01.06.2033 | 2.037.066 | 0,08 |
| 6.221.887 | Leviathan Bond Ltd* | 6,75 % | 30.06.2030 | 5.696.492 | 0,22 |
| 17.190.582 | MC Brazil Downstream Trading Sarl** | 7,25 % | 30.06.2031 | 13.493.576 | 0,51 |
| 2.850.000 | MDGH GMTN RSC Ltd* | 4,38 % | 22.11.2033 | 2.779.710 | 0,11 |
| 991.000 | MDGH GMTN RSC Ltd** | 5,08 % | 22.05.2053 | 978.271 | 0,04 |
| 2.196.000 | MDGH GMTN RSC Ltd* | 5,50 % | 28.04.2033 | 2.329.473 | 0,09 |
| 2.421.000 | MDGH GMTN RSC Ltd* | 5,88 % | 01.05.2034 | 2.646.858 | 0,10 |
| 4.652.000 | Medco Bell Pte Ltd** | 6,38 % | 30.01.2027 | 4.432.481 | 0,17 |
| 2.334.000 | Meituan* | 3,05 % | 28.10.2030 | 1.971.714 | 0,07 |
| 3.734.000 | Mexico City Airport Trust* | 5,50 % | 31.07.2047 | 3.227.427 | 0,12 |
| 4.496.000 | NBK Tier 1 Financing 2 Ltd* | 4,50 % | 29.12.2049 | 4.323.601 | 0,16 |
| 11.954.000 | Nexa Resources SA** | 5,38 % | 04.05.2027 | 11.679.033 | 0,44 |

Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 27,64 % (31. Dezember 2022: 31,50 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 3.167.000 | NWD MTN Ltd** | 4,13 % | 18.07.2029 | 2.416.547 | 0,09 |
| 14.318.000 | Oil & Gas Holding Co BSCC** | 7,50 % | 25.10.2027 | 15.153.169 | 0,57 |
| 4.043.000 | Ooredoo International Finance Ltd* | 2,63 % | 08.04.2031 | 3.532.357 | 0,13 |
| 4.474.000 | Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III* | 4,70 % | 06.06.2032 | 4.521.760 | 0,17 |
| 2.675.000 | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara* | 4,38 % | 05.02.2050 | 2.217.468 | 0,08 |
| 8.423.000 | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara* | 5,25 % | 15.05.2047 | 7.909.660 | 0,30 |
| 15.682.000 | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara* | 6,15 % | 21.05.2048 | 16.105.492 | 0,61 |
| 10.489.000 | Petrobras Global Finance BV* | 6,50 % | 03.07.2033 | 10.659.362 | 0,40 |
| 11.455.000 | Petroleos de Venezuela SA* | 5,38 % | 12.04.2027 | 1.277.233 | 0,05 |
| 730.000 | Petroleos de Venezuela SA* | 5,50 % | 12.04.2037 | 82.125 | 0,00 |
| 38.698.964 | Petroleos de Venezuela SA* | 6,00 % | 16.05.2024 | 4.449.525 | 0,17 |
| 26.169.079 | Petroleos de Venezuela SA** | 6,00 % | 15.11.2026 | 3.042.155 | 0,11 |
| 5.618.000 | Petroleos del Peru SA* | 4,75 % | 19.06.2032 | 4.037.140 | 0,15 |
| 25.851.000 | Petroleos del Peru SA* | 5,63 % | 19.06.2047 | 15.949.421 | 0,60 |
| 6.035.000 | Petroleos Mexicanos** | 6,95 % | 28.01.2060 | 3.982.291 | 0,15 |
| 59.060.000 | Petroleos Mexicanos** | 7,69 % | 23.01.2050 | 42.076.376 | 1,59 |
| 3.706.000 | Power Finance Corp Ltd* | 3,95 % | 23.04.2030 | 3.431.441 | 0,13 |
| 2.898.000 | Powerchina Roadbridge Group British Virgin Islands Ltd** | 3,08 % | 29.12.2049 | 2.727.453 | 0,10 |
| 4.596.000 | QatarEnergy* | 3,30 % | 12.07.2051 | 3.366.561 | 0,13 |
| 3.147.000 | QNB Finance Ltd* | 2,75 % | 12.02.2027 | 2.940.085 | 0,11 |
| 12.097.000 | Reliance Industries Ltd* | 2,88 % | 12.01.2032 | 10.372.937 | 0,39 |
| 8.411.000 | Reliance Industries Ltd* | 3,63 % | 12.01.2052 | 6.181.044 | 0,23 |
| 4.850.000 | Sasol Financing USA LLC* | 5,88 % | 27.03.2024 | 4.824.684 | 0,18 |
| 10.610.000 | Sasol Financing USA LLC* | 6,50 % | 27.09.2028 | 10.119.108 | 0,38 |
| 5.969.000 | Sasol Financing USA LLC* | 8,75 % | 03.05.2029 | 6.096.273 | 0,23 |
| 9.894.000 | Saudi Arabian Oil Co* | 4,25 % | 16.04.2039 | 8.871.811 | 0,33 |
| 1.782.000 | Saudi Electricity Sukuk Programme Co* | 5,68 % | 11.04.2053 | 1.833.190 | 0,07 |
| 50.492.000 | Southern Gas Corridor CJSC* | 6,88 % | 24.03.2026 | 51.365.512 | 1,94 |
| 27.571.000 | State Oil Co of the Azerbaijan Republic* | 6,95 % | 18.03.2030 | 29.070.173 | 1,10 |
| 4.484.000 | Suzano Austria GmbH** | 7,00 % | 16.03.2047 | 4.747.388 | 0,18 |
| 1.876.000 | Telecomunicaciones Digitales SA** | 4,50 % | 30.01.2030 | 1.618.802 | 0,06 |
| 6.803.000 | Tencent Holdings Ltd* | 3,24 % | 03.06.2050 | 4.542.407 | 0,17 |
| 778.000 | Tencent Holdings Ltd** | 3,29 % | 03.06.2060 | 493.395 | 0,02 |
| 5.985.000 | Tengizchevroil Finance Co International Ltd** | 3,25 % | 15.08.2030 | 4.946.124 | 0,19 |
| 1.900.000 | Tengizchevroil Finance Co International Ltd** | 2,63 % | 15.08.2025 | 1.792.257 | 0,07 |
| 4.752.000 | Turkiye Vakiflar Bankasi TAO* | 6,50 % | 08.01.2026 | 4.720.851 | 0,18 |
| 6.352.000 | Turkiye Vakiflar Bankasi TAO* | 9,00 % | 12.10.2028 | 6.676.841 | 0,25 |
| 42.750 | Ukreximbank Via Biz Finance Plc** | 9,75 % | 22.01.2025 | 41.493 | 0,00 |
| 11.580.000 | Vedanta Resources Finance II Plc* | 8,95 % | 11.03.2025 | 8.621.773 | 0,33 |
| 450.000 | Vnesheconombank Via VEB Finance Plc* | 6,80 % | 22.11.2025 | 31.091 | 0,00 |
| US-Dollar insgesamt | | | | 710.090.994 | 26,80 |
| Unternehmensanleihen insgesamt | | | | 732.442.764 | 27,64 |

Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 67,71 % (31. Dezember 2022: 60,52 %) | | | | | |
| Euro | | | | | |
| 7.246.146 | Argentine Republic Government International Bond* | 0,13 % | 09.07.2030 | 2.898.797 | 0,11 |
| 1.008.000 | Bank Gospodarstwa Krajowego* | 0,50 % | 08.07.2031 | 871.087 | 0,03 |
| 10.976.000 | Bank Gospodarstwa Krajowego* | 5,13 % | 22.02.2033 | 13.211.588 | 0,50 |
| 1.825.000 | Benin Government International Bond* | 4,88 % | 19.01.2032 | 1.655.286 | 0,06 |
| 9.957.000 | Benin Government International Bond* | 4,95 % | 22.01.2035 | 8.696.084 | 0,33 |
| 1.367.000 | Benin Government International Bond* | 6,88 % | 19.01.2052 | 1.193.096 | 0,04 |
| 2.600.000 | Chile Government International Bond* | 0,83 % | 02.07.2031 | 2.382.011 | 0,09 |
| 2.555.856 | Chile Government International Bond* | 4,13 % | 05.07.2034 | 2.890.098 | 0,11 |
| 1.757.000 | Egypt Government International Bond* | 4,75 % | 11.04.2025 | 1.772.940 | 0,07 |
| 3.170.000 | Egypt Government International Bond* | 4,75 % | 16.04.2026 | 2.852.290 | 0,11 |
| 10.344.000 | Egypt Government International Bond* | 5,63 % | 16.04.2030 | 7.328.340 | 0,28 |
| 26.313.000 | Egypt Government International Bond* | 6,38 % | 11.04.2031 | 18.736.017 | 0,71 |
| 1.600.000 | Indonesia Government International Bond* | 1,00 % | 28.07.2029 | 1.543.362 | 0,06 |
| 13.889.000 | Indonesia Government International Bond* | 1,10 % | 12.03.2033 | 12.177.345 | 0,46 |
| 32.691.000 | Indonesia Government International Bond* | 1,40 % | 30.10.2031 | 30.707.032 | 1,16 |
| 4.420.000 | Ivory Coast Government International Bond* | 4,88 % | 30.01.2032 | 4.127.686 | 0,15 |
| 19.259.000 | Ivory Coast Government International Bond* | 5,25 % | 22.03.2030 | 19.149.370 | 0,72 |
| 6.400.000 | Ivory Coast Government International Bond* | 5,88 % | 17.10.2031 | 6.357.835 | 0,24 |
| 25.722.000 | Ivory Coast Government International Bond* | 6,63 % | 22.03.2048 | 22.731.045 | 0,86 |
| 35.471.000 | Ivory Coast Government International Bond* | 6,88 % | 17.10.2040 | 32.901.998 | 1,24 |
| 1.018.000 | Kazakhstan Government International Bond* | 2,38 % | 09.11.2028 | 1.085.293 | 0,04 |
| 3.764.000 | Magyar Export-Import Bank Zrt* | 6,00 % | 16.05.2029 | 4.422.312 | 0,17 |
| 800.000 | Mexico Government International Bond* | 2,25 % | 12.08.2036 | 696.766 | 0,03 |
| 31.575.000 | Peruvian Government International Bond* | 1,25 % | 11.03.2033 | 27.463.839 | 1,04 |
| 17.290.000 | Peruvian Government International Bond* | 1,95 % | 17.11.2036 | 14.448.790 | 0,54 |
| 10.662.000 | Peruvian Government International Bond* | 3,75 % | 01.03.2030 | 11.725.014 | 0,44 |
| 9.245.000 | Philippine Government International Bond* | 1,75 % | 28.04.2041 | 7.164.725 | 0,27 |
| 2.675.372 | Provincia de Buenos Aires* | 4,50 % | 01.09.2037 | 1.026.053 | 0,04 |
| 10.227.000 | Republic of Cameroon International Bond* | 5,95 % | 07.07.2032 | 8.370.136 | 0,32 |
| 3.314.000 | Romanian Government International Bond* | 2,00 % | 28.01.2032 | 2.842.740 | 0,11 |
| 9.494.000 | Romanian Government International Bond* | 2,00 % | 14.04.2033 | 7.878.927 | 0,30 |
| 817.000 | Romanian Government International Bond* | 2,12 % | 16.07.2031 | 722.251 | 0,03 |
| 5.745.000 | Romanian Government International Bond* | 2,63 % | 02.12.2040 | 4.282.314 | 0,16 |
| 3.517.000 | Romanian Government International Bond* | 2,88 % | 13.04.2042 | 2.637.322 | 0,10 |
| 28.187.000 | Romanian Government International Bond* | 3,38 % | 28.01.2050 | 21.328.687 | 0,80 |
| 955.000 | Romanian Government International Bond* | 3,62 % | 26.05.2030 | 972.404 | 0,04 |
| 36.654.000 | Romanian Government International Bond* | 3,75 % | 07.02.2034 | 35.012.132 | 1,32 |
| 26.936.000 | Romanian Government International Bond* | 3,88 % | 29.10.2035 | 25.450.872 | 0,96 |
| 4.006.000 | Romanian Government International Bond* | 6,38 % | 18.09.2033 | 4.688.600 | 0,18 |
| 6.507.000 | Senegal Government International Bond* | 4,75 % | 13.03.2028 | 6.656.911 | 0,25 |

Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 67,71 % (31. Dezember 2022: 60,52 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Euro (Fortsetzung) | | | | | |
| 33.379.000 | Serbia International Bond* | 1,50 % | 26.06.2029 | 31.229.093 | 1,18 |
| 15.589.000 | Serbia International Bond* | 1,65 % | 03.03.2033 | 12.773.430 | 0,48 |
| 16.343.000 | Serbia International Bond* | 2,05 % | 23.09.2036 | 12.608.331 | 0,47 |
| 833.000 | Serbia International Bond* | 3,13 % | 15.05.2027 | 882.467 | 0,03 |
| 6.760.000 | Tunisian Republic* | 5,63 % | 17.02.2024 | 7.229.297 | 0,27 |
| 9.831.000 | Tunisian Republic* | 6,38 % | 15.07.2026 | 7.612.035 | 0,29 |
| 8.226.000 | Ukraine Government International Bond** | 6,75 % | 20.06.2028 | 2.244.434 | 0,08 |
| Euro insgesamt | | | | 457.638.482 | 17,27 |
| US-Dollar | | | | | |
| 5.924.000 | Abu Dhabi Government International Bond* | 2,70 % | 02.09.2070 | 3.765.117 | 0,14 |
| 4.643.000 | Angolan Government International Bond* | 8,25 % | 09.05.2028 | 4.291.688 | 0,16 |
| 24.627.000 | Angolan Government International Bond* | 8,75 % | 14.04.2032 | 21.726.481 | 0,82 |
| 4.285.000 | Angolan Government International Bond* | 9,13 % | 26.11.2049 | 3.508.344 | 0,13 |
| 38.843.000 | Angolan Government International Bond* | 9,38 % | 08.05.2048 | 32.425.282 | 1,22 |
| 30.687.000 | Arab Republic of Egypt* | 8,88 % | 29.05.2050 | 19.642.380 | 0,74 |
| 83.941.215 | Argentine Republic Government International Bond* | 0,75 % | 09.07.2030 | 33.870.844 | 1,28 |
| 9.830.000 | Argentine Republic Government International Bond* | 1,00 % | 09.07.2029 | 3.951.660 | 0,15 |
| 148.282.658 | Argentine Republic Government International Bond* | 3,63 % | 09.07.2035 | 51.241.323 | 1,93 |
| 12.800.000 | Bahamas Government International Bond* | 6,00 % | 21.11.2028 | 11.392.000 | 0,43 |
| 4.706.000 | Bank Gospodarstwa Krajowego* | 5,38 % | 22.05.2033 | 4.781.432 | 0,18 |
| 1.807.000 | Bank Gospodarstwa Krajowego* | 6,25 % | 31.10.2028 | 1.910.687 | 0,07 |
| 2.674.000 | Bermuda Government International Bond* | 2,38 % | 20.08.2030 | 2.302.020 | 0,09 |
| 10.298.000 | Bermuda Government International Bond* | 4,75 % | 15.02.2029 | 10.260.412 | 0,39 |
| 11.958.000 | Bermuda Government International Bond* | 5,00 % | 15.07.2032 | 11.892.231 | 0,45 |
| 10.178.000 | Brazilian Government International Bond* | 5,63 % | 07.01.2041 | 9.433.542 | 0,36 |
| 12.816.000 | Brazilian Government International Bond* | 5,63 % | 21.02.2047 | 11.298.805 | 0,43 |
| 18.673.000 | Brazilian Government International Bond* | 6,00 % | 20.10.2033 | 18.713.992 | 0,71 |
| 4.319.000 | Brazilian Government International Bond** | 6,25 % | 18.03.2031 | 4.487.878 | 0,17 |
| 6.492.000 | Chile Government International Bond* | 3,25 % | 21.09.2071 | 4.374.841 | 0,16 |
| 3.112.000 | Chile Government International Bond* | 4,95 % | 05.01.2036 | 3.082.979 | 0,12 |
| 19.946.000 | Colombia Government International Bond* | 3,00 % | 30.01.2030 | 16.882.693 | 0,64 |
| 24.593.000 | Colombia Government International Bond* | 5,00 % | 15.06.2045 | 19.166.923 | 0,72 |
| 25.758.000 | Colombia Government International Bond* | 5,20 % | 15.05.2049 | 20.206.299 | 0,76 |
| 7.245.000 | Colombia Government International Bond* | 6,13 % | 18.01.2041 | 6.609.177 | 0,25 |
| 30.377.000 | Colombia Government International Bond* | 7,50 % | 02.02.2034 | 32.139.688 | 1,21 |
| 7.603.000 | Colombia Government International Bond* | 8,00 % | 20.04.2033 | 8.306.469 | 0,31 |
| 4.876.000 | Colombia Government International Bond** | 8,00 % | 14.11.2035 | 5.343.997 | 0,20 |
| 3.615.000 | Colombia Government International Bond* | 8,75 % | 14.11.2053 | 4.165.399 | 0,16 |

Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 67,71 % (31. Dezember 2022: 60,52 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 1.043.000 | Corp Financiera de Desarrollo SA* | 2,40 % | 28.09.2027 | 930.283 | 0,03 |
| 6.603.000 | Costa Rica Government International Bond* | 6,55 % | 03.04.2034 | 6.854.739 | 0,26 |
| 2.809.000 | Costa Rica Government International Bond* | 7,00 % | 04.04.2044 | 2.943.832 | 0,11 |
| 1.471.000 | Costa Rica Government International Bond* | 7,16 % | 12.03.2045 | 1.565.144 | 0,06 |
| 14.099.000 | Costa Rica Government International Bond* | 7,30 % | 13.11.2054 | 15.332.663 | 0,58 |
| 40.427.000 | Dominican Republic International Bond* | 5,88 % | 30.01.2060 | 35.069.154 | 1,32 |
| 6.800.000 | Dominican Republic International Bond* | 6,00 % | 19.07.2028 | 6.828.560 | 0,26 |
| 4.757.000 | Dominican Republic International Bond* | 6,00 % | 22.02.2033 | 4.703.484 | 0,18 |
| 25.430.000 | Dominican Republic International Bond* | 6,85 % | 27.01.2045 | 25.430.000 | 0,96 |
| 633.000 | Dominican Republic International Bond* | 7,05 % | 03.02.2031 | 666.233 | 0,02 |
| 6.407.540 | Ecuador Government International Bond* | 0,00 % | 31.07.2030 | 1.843.612 | 0,07 |
| 19.683.223 | Ecuador Government International Bond* | 2,50 % | 31.07.2040 | 6.298.631 | 0,24 |
| 92.184.478 | Ecuador Government International Bond* | 3,50 % | 31.07.2035 | 33.217.453 | 1,25 |
| 10.350.055 | Ecuador Government International Bond* | 6,00 % | 31.07.2030 | 4.836.673 | 0,18 |
| 8.531.000 | Egypt Government International Bond* | 7,90 % | 21.02.2048 | 5.167.355 | 0,19 |
| 33.950.000 | Egypt Government International Bond* | 8,50 % | 31.01.2047 | 21.233.756 | 0,80 |
| 5.113.000 | Egypt Government International Bond* | 8,70 % | 01.03.2049 | 3.216.614 | 0,12 |
| 1.040.000 | El Salvador Government International Bond* | 7,63 % | 01.02.2041 | 785.902 | 0,03 |
| 21.289.000 | El Salvador Government International Bond* | 7,65 % | 15.06.2035 | 16.685.254 | 0,63 |
| 49.903.000 | El Salvador Government International Bond* | 9,50 % | 15.07.2052 | 41.796.243 | 1,58 |
| 4.130.000 | Emirate of Dubai Government International Bonds* | 3,90 % | 09.09.2050 | 3.118.910 | 0,12 |
| 9.580.000 | Ethiopia International Bond* | 6,63 % | 11.12.2024 | 6.511.104 | 0,25 |
| 2.000.000 | Ghana Government International Bond* | 6,38 % | 11.02.2027 | 898.100 | 0,03 |
| 13.833.000 | Ghana Government International Bond* | 7,63 % | 16.05.2029 | 6.066.504 | 0,23 |
| 14.443.000 | Ghana Government International Bond* | 7,75 % | 07.04.2029 | 6.349.576 | 0,24 |
| 12.017.000 | Ghana Government International Bond* | 7,88 % | 11.02.2035 | 5.291.854 | 0,20 |
| 11.138.000 | Ghana Government International Bond* | 8,63 % | 07.04.2034 | 4.891.609 | 0,18 |
| 5.375.000 | Ghana Government International Bond* | 8,75 % | 11.03.2061 | 2.334.255 | 0,09 |
| 4.857.000 | Ghana Government International Bond* | 8,88 % | 07.05.2042 | 2.097.738 | 0,08 |
| 7.783.000 | Ghana Government International Bond* | 8,95 % | 26.03.2051 | 3.381.247 | 0,13 |
| 30.412.000 | Ghana Government International Bond* | 10,75 % | 14.10.2030 | 19.254.628 | 0,73 |
| 5.237.000 | Guatemala Government Bond* | 3,70 % | 07.10.2033 | 4.382.714 | 0,17 |
| 735.000 | Guatemala Government Bond* | 5,25 % | 10.08.2029 | 722.321 | 0,03 |
| 5.190.000 | Guatemala Government Bond* | 5,38 % | 24.04.2032 | 5.039.801 | 0,19 |
| 28.783.000 | Guatemala Government Bond* | 6,60 % | 13.06.2036 | 29.718.449 | 1,12 |
| 2.898.000 | Guatemala Government Bond* | 7,05 % | 04.10.2032 | 3.086.732 | 0,12 |
| 5.435.000 | Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS* | 8,51 % | 14.01.2029 | 5.771.970 | 0,22 |
| 3.260.000 | Honduras Government International Bond* | 5,63 % | 24.06.2030 | 2.913.625 | 0,11 |
| 1.247.000 | Honduras Government International Bond* | 6,25 % | 19.01.2027 | 1.200.238 | 0,05 |

Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 67,71 % (31. Dezember 2022: 60,52 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 6.360.000 | Indonesia Government International Bond* | 5,65 % | 11.01.2053 | 7.018.968 | 0,26 |
| 400.000 | Indonesia Government International Bond* | 7,75 % | 17.01.2038 | 514.114 | 0,02 |
| 3.637.000 | Indonesia Government International Bond* | 8,50 % | 12.10.2035 | 4.846.303 | 0,18 |
| 829.125 | Iraq International Bond* | 5,80 % | 15.01.2028 | 777.281 | 0,03 |
| 2.935.000 | Istanbul Metropolitan Municipality* | 10,50 % | 06.12.2028 | 3.122.106 | 0,12 |
| 6.335.043 | Ivory Coast Government International Bond* | 5,75 % | 31.12.2032 | 6.002.137 | 0,23 |
| 1.986.000 | Jordan Government International Bond* | 7,38 % | 10.10.2047 | 1.770.730 | 0,07 |
| 45.992.000 | Lebanon Government International Bond* | 6,38 % | 09.03.2020 | 2.817.010 | 0,11 |
| 21.038.000 | Lebanon Government International Bond* | 6,60 % | 27.11.2026 | 1.294.089 | 0,05 |
| 58.532.000 | Lebanon Government International Bond* | 6,65 % | 26.02.2030 | 3.667.685 | 0,14 |
| 6.112.000 | Lebanon Government International Bond* | 6,85 % | 25.05.2029 | 377.984 | 0,01 |
| 83.325.000 | Lebanon Government International Bond* | 8,25 % | 17.05.2034 | 5.189.064 | 0,20 |
| 46.520.000 | Mexico Government International Bond* | 5,75 % | 12.10.2110 | 41.806.387 | 1,58 |
| 11.771.000 | Mongolia Government International Bond* | 3,50 % | 07.07.2027 | 10.533.176 | 0,40 |
| 8.042.000 | Mongolia Government International Bond* | 5,13 % | 07.04.2026 | 7.820.105 | 0,29 |
| 2.550.000 | Mongolia Government International Bond* | 7,88 % | 05.06.2029 | 2.611.179 | 0,10 |
| 16.319.000 | Mongolia Government International Bond* | 8,65 % | 19.01.2028 | 17.123.643 | 0,65 |
| 7.320.000 | Morocco Government International Bond* | 3,00 % | 15.12.2032 | 6.039.761 | 0,23 |
| 6.001.000 | Morocco Government International Bond* | 6,50 % | 08.09.2033 | 6.343.675 | 0,24 |
| 328.000 | Nigeria Government International Bond* | 7,63 % | 21.11.2025 | 325.307 | 0,01 |
| 2.059.000 | Nigeria Government International Bond* | 7,70 % | 23.02.2038 | 1.694.256 | 0,06 |
| 18.881.000 | Nigeria Government International Bond* | 7,88 % | 16.02.2032 | 17.025.942 | 0,64 |
| 5.653.000 | Nigeria Government International Bond* | 8,25 % | 28.09.2051 | 4.655.472 | 0,18 |
| 1.326.000 | Nigeria Government International Bond* | 8,38 % | 24.03.2029 | 1.276.335 | 0,05 |
| 10.975.000 | Nigeria Government International Bond* | 8,75 % | 21.01.2031 | 10.497.203 | 0,40 |
| 12.420.000 | Nigeria Government International Bond* | 9,25 % | 21.01.2049 | 11.219.980 | 0,42 |
| 1.414.000 | Oman Government International Bond* | 6,50 % | 08.03.2047 | 1.444.941 | 0,05 |
| 36.098.000 | Oman Government International Bond* | 6,75 % | 17.01.2048 | 37.858.499 | 1,43 |
| 7.965.000 | Oman Government International Bond* | 7,00 % | 25.01.2051 | 8.615.446 | 0,32 |
| 2.425.000 | Panama Government International Bond* | 3,87 % | 23.07.2060 | 1.458.460 | 0,05 |
| 1.560.000 | Panama Government International Bond* | 4,30 % | 29.04.2053 | 1.048.846 | 0,04 |
| 1.648.000 | Panama Government International Bond* | 4,50 % | 16.04.2050 | 1.147.682 | 0,04 |
| 16.570.000 | Panama Government International Bond* | 4,50 % | 01.04.2056 | 11.169.683 | 0,42 |
| 1.893.000 | Panama Government International Bond* | 4,50 % | 19.01.2063 | 1.243.159 | 0,05 |
| 23.468.000 | Panama Government International Bond* | 6,40 % | 14.02.2035 | 22.965.024 | 0,87 |
| 8.962.000 | Panama Government International Bond* | 6,70 % | 26.01.2036 | 8.903.665 | 0,34 |
| 9.848.000 | Panama Government International Bond* | 6,85 % | 28.03.2054 | 9.239.045 | 0,35 |
| 2.270.000 | Panama Government International Bond* | 6,88 % | 31.01.2036 | 2.270.603 | 0,09 |
| 8.224.000 | Papua New Guinea Government International Bond* | 8,38 % | 04.10.2028 | 7.866.256 | 0,30 |
| 3.375.000 | Paraguay Government International Bond* | 5,40 % | 30.03.2050 | 3.009.657 | 0,11 |

Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|----------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 67,71 % (31. Dezember 2022: 60,52 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 19.082.000 | Paraguay Government International Bond* | 5,60 % | 13.03.2048 | 17.451.972 | 0,66 |
| 11.800.000 | Provincia de Buenos Aires* | 6,38 % | 01.09.2037 | 4.548.495 | 0,17 |
| 432.007 | Provincia de Cordoba* | 6,88 % | 10.12.2025 | 393.207 | 0,01 |
| 3.182.385 | Provincia de Mendoza Argentina* | 5,75 % | 19.03.2029 | 2.728.895 | 0,10 |
| 27.657.000 | Qatar Government International Bond* | 4,82 % | 14.03.2049 | 26.987.286 | 1,02 |
| 15.572.000 | Republic of Armenia International Bond* | 3,60 % | 02.02.2031 | 12.771.812 | 0,48 |
| 4.860.000 | Republic of Azerbaijan International Bond* | 3,50 % | 01.09.2032 | 4.228.278 | 0,16 |
| 800.000 | Republic of Azerbaijan International Bond* | 5,13 % | 01.09.2029 | 787.465 | 0,03 |
| 14.739.000 | Republic of Poland Government International Bond* | 5,50 % | 04.04.2053 | 15.406.618 | 0,58 |
| 2.482.000 | Republic of Poland Government International Bond* | 5,75 % | 16.11.2032 | 2.685.251 | 0,10 |
| 20.508.000 | Republic of South Africa Government International Bond* | 5,75 % | 30.09.2049 | 16.439.213 | 0,62 |
| 28.150.000 | Republic of South Africa Government International Bond* | 7,30 % | 20.04.2052 | 26.739.854 | 1,01 |
| 1.472.000 | Republic of Uzbekistan International Bond* | 5,38 % | 20.02.2029 | 1.397.721 | 0,05 |
| 11.443.000 | Sri Lanka Government International Bond* | 5,75 % | 18.04.2023 | 5.885.993 | 0,22 |
| 2.503.000 | Sri Lanka Government International Bond* | 5,88 % | 25.07.2024 | 1.325.339 | 0,05 |
| 6.070.000 | Sri Lanka Government International Bond* | 6,13 % | 03.06.2025 | 3.133.508 | 0,12 |
| 18.566.000 | Sri Lanka Government International Bond* | 6,20 % | 11.05.2027 | 9.427.863 | 0,36 |
| 15.440.000 | Sri Lanka Government International Bond* | 6,75 % | 18.04.2028 | 7.805.820 | 0,29 |
| 14.406.000 | Sri Lanka Government International Bond* | 6,85 % | 14.03.2024 | 7.335.903 | 0,28 |
| 15.107.000 | Sri Lanka Government International Bond* | 6,85 % | 03.11.2025 | 7.817.839 | 0,29 |
| 17.628.000 | Sri Lanka Government International Bond* | 7,55 % | 28.03.2030 | 8.899.866 | 0,34 |
| 40.882.000 | Sri Lanka Government International Bond* | 7,85 % | 14.03.2029 | 20.648.604 | 0,78 |
| 6.462.000 | State Agency of Roads of Ukraine* | 6,25 % | 24.06.2030 | 1.665.581 | 0,06 |
| 15.411.000 | Turkiye Government International Bond* | 9,13 % | 13.07.2030 | 17.047.186 | 0,64 |
| 6.563.000 | Turkiye Government International Bond* | 9,38 % | 14.03.2029 | 7.273.904 | 0,27 |
| 4.502.000 | Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS* | 9,38 % | 31.01.2026 | 4.718.501 | 0,18 |
| 4.928.000 | Ukraine Government International Bond* | 6,88 % | 21.05.2031 | 1.149.210 | 0,04 |
| 1.713.000 | Ukraine Government International Bond* | 7,25 % | 15.03.2035 | 412.588 | 0,02 |
| 13.562.000 | Ukraine Government International Bond* | 7,38 % | 25.09.2034 | 3.221.653 | 0,12 |
| 18.078.000 | Ukraine Government International Bond* | 7,75 % | 01.09.2027 | 5.000.736 | 0,19 |
| 13.893.000 | Ukraine Government International Bond* | 7,75 % | 01.09.2029 | 3.852.626 | 0,15 |
| 21.027.000 | Ukraine Government International Bond* | 7,75 % | 01.08.2041 | 9.485.427 | 0,36 |
| 20.660.000 | Ukraine Government International Bond* | 9,75 % | 01.11.2030 | 5.991.400 | 0,23 |
| 10.314.000 | Uzbekneftegaz JSC* | 4,75 % | 16.11.2028 | 8.616.584 | 0,32 |
| 32.118.500 | Venezuela Government International Bond* | 8,25 % | 13.10.2024 | 5.049.820 | 0,19 |
| 14.430.000 | Zambia Government International Bond* | 5,38 % | 20.09.2022 | 8.112.330 | 0,31 |
| 6.140.000 | Zambia Government International Bond* | 8,50 % | 14.04.2024 | 3.840.140 | 0,14 |
| 35.408.000 | Zambia Government International Bond* | 8,97 % | 30.07.2027 | 22.037.231 | 0,83 |
| US-Dollar insgesamt | | | | 1.336.544.120 | 50,44 |
| Staatsanleihen insgesamt | | | | 1.794.182.602 | 67,71 |

Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|---|--|----------------------|----------------------|
| Investmentfonds 0,66 % (31. Dezember 2022: 0,65 %) | | | |
| US-Dollar | | | |
| 150.000 | Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund | 17.580.000 | 0,66 |
| Investmentfonds insgesamt ¹⁾ | | 17.580.000 | 0,66 |
| Anlagen insgesamt | | 2.544.205.366 | 96,01 |

Devisenterminkontrakte 0,94 % (31. Dezember 2022: 0,50 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 540.071.184 US\$ | 488.041.561 € | 02.02.2024 | Citibank NA | 1 | 261.317 | 0,01 |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> | | | | | | |
| 24.943.593 AUD | 16.477.116 US\$ | 14.03.2024 | UBS AG | 4 | 580.222 | 0,02 |
| 633.467 AUD | 420.539 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 13 | 12.649 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> | | | | | | |
| 2.798.935 CHF | 3.252.651 US\$ | 14.03.2024 | Goldman Sachs International | 3 | 97.421 | 0,00 |
| 153.876.209 CHF | 177.741.159 US\$ | 14.03.2024 | UBS AG | 2 | 6.434.750 | 0,24 |
| 4.508.829 CHF | 5.231.287 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 9 | 165.373 | 0,01 |
| 18.709 US\$ | 15.535 CHF | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 115 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 9.877.653 € | 10.768.963 US\$ | 14.03.2024 | Goldman Sachs International | 2 | 173.829 | 0,01 |
| 505.423.704 € | 547.745.357 US\$ | 14.03.2024 | UBS AG | 2 | 12.179.779 | 0,46 |
| 26.075.899 € | 28.528.168 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 15 | 359.577 | 0,01 |
| 1.007.630 US\$ | 904.653 € | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 4 | 5.425 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 1.596.317 £ | 2.030.520 US\$ | 14.03.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 5.199 | 0,00 |
| 83.600.674 £ | 105.431.067 US\$ | 14.03.2024 | UBS AG | 2 | 1.181.504 | 0,05 |
| 3.272.877 £ | 4.129.662 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 17 | 44.106 | 0,00 |
| 87.068 US\$ | 68.195 £ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 4 | 101 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen HKD</i> | | | | | | |
| 1.361.088 HKD | 174.538 US\$ | 14.03.2024 | Goldman Sachs International | 4 | 62 | 0,00 |
| 17.428 HKD | 2.234 US\$ | 14.03.2024 | UBS AG | 2 | 1 | 0,00 |
| 86.235 HKD | 11.059 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 6 | 4 | 0,00 |
| 2.228 US\$ | 17.364 HKD | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | 1 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen JPY</i> | | | | | | |
| 55.341.721 ¥ | 395.185 US\$ | 14.03.2024 | Goldman Sachs International | 3 | 1.768 | 0,00 |
| 1.675.043.730 ¥ | 11.563.342 US\$ | 14.03.2024 | UBS AG | 2 | 451.341 | 0,02 |
| 23.808.684 ¥ | 166.179 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | 4.595 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i> | | | | | | |
| 16.167.394 SEK | 1.576.775 US\$ | 14.03.2024 | Goldman Sachs International | 2 | 32.012 | 0,00 |
| 699.411.443 SEK | 67.015.687 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 9 | 2.581.440 | 0,10 |
| 1.567 US\$ | 15.548 SEK | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 20 | 0,00 |

Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 0,94 % (31. Dezember 2022: 0,50 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i> | | | | | | |
| 23.183.806 SGD | 17.371.032 US\$ | 14.03.2024 | Goldman Sachs International | 6 | 262.563 | 0,01 |
| 442.286 SGD | 332.455 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 11 | 3.950 | 0,00 |
| 29 US\$ | 38 SGD | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 0 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ^{an} | | | | | 24.839.124 | 0,94 |

Futures-Kontrakte 0,74 % (31. Dezember 2022: 0,93 %)

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|--|--------------------------------|----------------------|
| 261 | Euro-BOBL Future March 2024 | 279.664 | 0,01 |
| 801 | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2024 | 3.285.352 | 0,12 |
| 684 | US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2024 | 1.544.344 | 0,06 |
| 2.838 | US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2024 | 7.083.798 | 0,27 |
| 502 | US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2024 | 5.043.531 | 0,19 |
| 271 | US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2024 | 2.331.625 | 0,09 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten ^{an} | | 19.568.314 | 0,74 |

| | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|----------------------|----------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 2.588.612.804 | 97,69 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,21 %) (31. Dezember 2022: (0,43 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|----------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 488.041.561 € | 539.437.218 US\$ | 03.01.2024 | Citibank NA | 1 | (322.041) | (0,01) |
| 23.589.737 US\$ | 21.482.000 € | 03.01.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | (140.358) | (0,01) |
| 510.507.792 US\$ | 466.559.561 € | 03.01.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | (4.877.290) | (0,18) |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> | | | | | | |
| 21.489 AUD | 14.754 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | (58) | (0,00) |
| 232.469 US\$ | 348.524 AUD | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 13 | (5.865) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> | | | | | | |
| 2.007.205 US\$ | 1.720.656 CHF | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 24 | (52.266) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 8.910.419 US\$ | 8.149.411 € | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 19 | (117.771) | (0,01) |

Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (0,21 %) (31. Dezember 2022: (0,43 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 802.294 £ | 1.025.677 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 4 | (2.544) | (0,00) |
| 605.158 US\$ | 481.385 £ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 13 | (8.734) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen HKD</i> | | | | | | |
| 32.151 HKD | 4.126 US\$ | 14.03.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (1) | (0,00) |
| 52.635 HKD | 6.752 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | 0 | (0,00) |
| 528 US\$ | 4.118 HKD | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 0 | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen JPY</i> | | | | | | |
| 59.642 US\$ | 8.554.284 ¥ | 14.03.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (1.716) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i> | | | | | | |
| 18.333.417 SEK | 1.854.042 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (29.718) | (0,00) |
| 349.277 US\$ | 3.637.463 SEK | 14.03.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (12.680) | (0,00) |
| 3.323.704 US\$ | 33.726.769 SEK | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 18 | (32.384) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i> | | | | | | |
| 680.217 SGD | 517.434 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | (61) | (0,00) |
| 82.934 US\$ | 110.898 SGD | 14.03.2024 | UBS AG | 1 | (1.415) | (0,00) |
| 3.094.522 US\$ | 4.130.606 SGD | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 19 | (47.216) | (0,00) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ^{oo} | | | | | (5.652.118) | (0,21) |

Futures-Kontrakte (0,39 %) (31. Dezember 2022: (0,05 %))

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|--|---------------------------------|----------------------|
| (1.710) | Euro-Bund Future March 2024 | (6.137.966) | (0,23) |
| (505) | Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2024 | (4.068.669) | (0,16) |
| (43) | Euro-Schatz Future March 2024 | (16.150) | (0,00) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten [*] | | (10.222.785) | (0,39) |

| | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|---|----------------------|----------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (15.874.903) | (0,60) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | 2.572.737.901 | 97,09 |
| Sonstiges Nettovermögen | 77.080.754 | 2,91 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | 2.649.818.655 | 100,00 |

Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

| Portfolioanalyse | US\$ | % des Gesamtver- mögens |
|---|----------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 2.331.719.144 | 87,09 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 194.906.222 | 7,28 |
| μ Investmentfonds | 17.580.000 | 0,66 |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 9.345.529 | 0,35 |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente | 19.187.006 | 0,72 |
| Anlagen insgesamt | 2.572.737.901 | 96,10 |

Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Schatzwechsel 2,59 % (31. Dezember 2022: 0,00 %) | | | | | |
| Thailändischer Baht | | | | | |
| 259.670.000 | Bank of Thailand Bill | 0,00 % | 09.05.2024 | 7.548.955 | 0,59 |
| Thailändischer Baht insgesamt | | | | 7.548.955 | 0,59 |
| US-Dollar | | | | | |
| 17.716.200 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 30.01.2024 | 17.643.335 | 1,37 |
| 8.308.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 16.05.2024 | 8.148.860 | 0,63 |
| US-Dollar insgesamt | | | | 25.792.195 | 2,00 |
| Schatzwechsel insgesamt ** | | | | 33.341.150 | 2,59 |
| Unternehmensanleihen 3,25 % (31. Dezember 2022: 1,62 %) | | | | | |
| Chinesischer Yuan Renminbi | | | | | |
| 50.000.000 | Central Huijin Investment Ltd** | 2,74 % | 24.05.2026 | 7.045.656 | 0,55 |
| 10.000.000 | Central Huijin Investment Ltd** | 2,80 % | 27.10.2026 | 1.411.078 | 0,11 |
| 20.000.000 | China Southern Power Grid Co Ltd** | 3,66 % | 25.02.2024 | 2.813.746 | 0,22 |
| Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt | | | | 11.270.480 | 0,88 |
| Kolumbianischer Peso | | | | | |
| 4.004.000.000 | Asian Development Bank* | 11,20 % | 31.01.2025 | 1.024.539 | 0,08 |
| 10.328.000.000 | Asian Development Bank* | 12,75 % | 03.03.2025 | 2.701.436 | 0,21 |
| 10.000.000.000 | Asian Development Bank* | 13,00 % | 07.03.2025 | 2.604.827 | 0,20 |
| 6.450.000.000 | Empresas Publicas de Medellin ESP* | 7,63 % | 10.09.2024 | 1.603.741 | 0,12 |
| 49.079.000.000 | Empresas Publicas de Medellin ESP* | 8,38 % | 08.11.2027 | 11.011.737 | 0,86 |
| 15.550.000.000 | International Finance Corp* | 0,00 % | 16.08.2028 | 2.601.916 | 0,20 |
| Kolumbianischer Peso insgesamt | | | | 21.548.196 | 1,67 |
| Mexikanischer Peso | | | | | |
| 102.700.000 | Asian Infrastructure Investment Bank* | 0,00 % | 08.02.2038 | 1.671.388 | 0,13 |
| 72.618.300 | Comision Federal de Electricidad* | 7,35 % | 25.11.2025 | 3.994.814 | 0,31 |
| 62.682.200 | Comision Federal de Electricidad* | 8,18 % | 23.12.2027 | 3.340.722 | 0,26 |
| Mexikanischer Peso insgesamt | | | | 9.006.924 | 0,70 |
| Unternehmensanleihen insgesamt | | | | 41.825.600 | 3,25 |
| Staatsanleihen 87,45 % (31. Dezember 2022: 92,36 %) | | | | | |
| Chilenischer Peso | | | | | |
| 6.439.587.000 | Bonos de la Tesoreria de la Republica* | 1,90 % | 01.09.2030 | 7.248.255 | 0,56 |
| 2.055.000.000 | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 2,80 % | 01.10.2033 | 1.927.140 | 0,15 |
| 5.865.000.000 | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 4,50 % | 01.03.2026 | 6.701.581 | 0,52 |
| 900.000.000 | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 4,70 % | 01.09.2030 | 1.009.825 | 0,08 |
| 2.335.000.000 | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 5,00 % | 01.03.2035 | 2.673.627 | 0,21 |

Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 87,45 % (31. Dezember 2022: 92,36 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Chilenischer Peso (Fortsetzung) | | | | | |
| 445.000.000 | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 5,10 % | 15.07.2050 | 509.596 | 0,04 |
| 2.115.000.000 | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 6,00 % | 01.04.2033 | 2.585.962 | 0,20 |
| 3.570.000.000 | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 7,00 % | 01.05.2034 | 4.687.627 | 0,37 |
| Chilenischer Peso insgesamt | | | | 27.343.613 | 2,13 |
| Chinesischer Yuan Renminbi | | | | | |
| 10.000.000 | China Development Bank** | 2,83 % | 10.09.2026 | 1.421.187 | 0,11 |
| 20.000.000 | China Development Bank** | 2,98 % | 22.04.2032 | 2.857.284 | 0,22 |
| 10.000.000 | China Development Bank** | 3,02 % | 06.03.2033 | 1.436.354 | 0,11 |
| 30.000.000 | China Development Bank** | 3,30 % | 03.03.2026 | 4.299.959 | 0,34 |
| 40.000.000 | China Development Bank** | 3,34 % | 14.07.2025 | 5.704.354 | 0,44 |
| 10.000.000 | China Development Bank** | 3,48 % | 08.01.2029 | 1.466.138 | 0,11 |
| 20.000.000 | China Development Bank** | 3,70 % | 20.10.2030 | 2.990.060 | 0,23 |
| 40.000.000 | China Development Bank** | 4,04 % | 06.07.2028 | 5.981.249 | 0,47 |
| 20.000.000 | China Development Bank** | 4,24 % | 24.08.2027 | 2.982.709 | 0,23 |
| 20.000.000 | China Government Bond** | 2,18 % | 15.08.2026 | 2.801.630 | 0,22 |
| 15.000.000 | China Government Bond** | 2,50 % | 25.07.2027 | 2.115.479 | 0,17 |
| 8.000.000 | China Government Bond** | 2,52 % | 25.08.2033 | 1.118.549 | 0,09 |
| 10.000.000 | China Government Bond** | 2,55 % | 15.10.2028 | 1.414.269 | 0,11 |
| 9.000.000 | China Government Bond** | 2,60 % | 15.09.2030 | 1.269.691 | 0,10 |
| 10.000.000 | China Government Bond** | 2,62 % | 15.04.2028 | 1.418.011 | 0,11 |
| 20.000.000 | China Government Bond** | 2,62 % | 25.09.2029 | 2.827.251 | 0,22 |
| 28.000.000 | China Government Bond** | 2,62 % | 25.06.2030 | 3.953.322 | 0,31 |
| 20.000.000 | China Government Bond** | 2,64 % | 15.01.2028 | 2.838.070 | 0,22 |
| 20.500.000 | China Government Bond** | 2,67 % | 25.05.2033 | 2.898.456 | 0,23 |
| 13.000.000 | China Government Bond** | 2,69 % | 15.08.2032 | 1.840.010 | 0,14 |
| 20.000.000 | China Government Bond** | 2,85 % | 04.06.2027 | 2.853.877 | 0,22 |
| 22.000.000 | China Government Bond** | 2,88 % | 25.02.2033 | 3.165.975 | 0,25 |
| 3.000.000 | China Government Bond** | 3,00 % | 15.10.2053 | 436.585 | 0,03 |
| 10.000.000 | China Government Bond** | 3,01 % | 13.05.2028 | 1.441.900 | 0,11 |
| 22.000.000 | China Government Bond** | 3,02 % | 27.05.2031 | 3.192.027 | 0,25 |
| 30.000.000 | China Government Bond** | 3,13 % | 21.11.2029 | 4.372.058 | 0,34 |
| 14.940.000 | China Government Bond** | 3,19 % | 15.04.2053 | 2.233.443 | 0,17 |
| 10.000.000 | China Government Bond** | 3,25 % | 22.11.2028 | 1.463.143 | 0,11 |
| 10.000.000 | China Government Bond** | 3,28 % | 03.12.2027 | 1.457.632 | 0,11 |
| 5.000.000 | China Government Bond** | 3,29 % | 23.05.2029 | 734.246 | 0,06 |
| 45.500.000 | China Government Bond** | 3,72 % | 12.04.2051 | 7.397.434 | 0,58 |
| Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt | | | | 82.382.352 | 6,41 |

Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 87,45 % (31. Dezember 2022: 92,36 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Kolumbianischer Peso | | | | | |
| 89.266.600.000 | Colombian TES* | 5,75 % | 03.11.2027 | 20.427.166 | 1,59 |
| 123.861.700.000 | Colombian TES* | 6,00 % | 28.04.2028 | 28.225.376 | 2,19 |
| 21.584.900.000 | Colombian TES* | 7,00 % | 26.03.2031 | 4.809.779 | 0,37 |
| 25.028.700.000 | Colombian TES* | 7,00 % | 30.06.2032 | 5.418.255 | 0,42 |
| 26.308.300.000 | Colombian TES* | 7,25 % | 18.10.2034 | 5.595.098 | 0,44 |
| 9.231.900.000 | Colombian TES* | 7,50 % | 26.08.2026 | 2.280.332 | 0,18 |
| 26.457.200.000 | Colombian TES* | 7,75 % | 18.09.2030 | 6.229.120 | 0,48 |
| 22.429.000.000 | Colombian TES* | 9,25 % | 28.05.2042 | 5.257.128 | 0,41 |
| 46.040.000.000 | Colombian TES* | 13,25 % | 09.02.2033 | 14.115.371 | 1,10 |
| 10.400.100.000 | Colombian TES Series G* | 7,00 % | 26.03.2031 | 2.317.462 | 0,18 |
| 1.303.000.000 | Financiera de Desarrollo Territorial SA Findeter* | 7,88 % | 12.08.2024 | 324.371 | 0,03 |
| Kolumbianischer Peso insgesamt | | | | 94.999.458 | 7,39 |
| Tschechische Krone | | | | | |
| 53.760.000 | Czech Republic Government Bond* | 0,05 % | 29.11.2029 | 1.946.113 | 0,15 |
| 496.230.000 | Czech Republic Government Bond* | 0,95 % | 15.05.2030 | 18.789.702 | 1,46 |
| 368.120.000 | Czech Republic Government Bond* | 1,00 % | 26.06.2026 | 15.290.051 | 1,19 |
| 215.890.000 | Czech Republic Government Bond* | 1,20 % | 13.03.2031 | 8.153.775 | 0,63 |
| 39.810.000 | Czech Republic Government Bond* | 1,50 % | 24.04.2040 | 1.282.475 | 0,10 |
| 96.070.000 | Czech Republic Government Bond* | 1,75 % | 23.06.2032 | 3.705.317 | 0,29 |
| 34.130.000 | Czech Republic Government Bond* | 1,95 % | 30.07.2037 | 1.231.303 | 0,10 |
| 79.870.000 | Czech Republic Government Bond* | 2,00 % | 13.10.2033 | 3.076.837 | 0,24 |
| 107.220.000 | Czech Republic Government Bond* | 2,40 % | 17.09.2025 | 4.640.225 | 0,36 |
| 36.630.000 | Czech Republic Government Bond* | 2,50 % | 25.08.2028 | 1.556.067 | 0,12 |
| 29.020.000 | Czech Republic Government Bond* | 2,75 % | 23.07.2029 | 1.234.378 | 0,10 |
| 35.400.000 | Czech Republic Government Bond* | 4,20 % | 04.12.2036 | 1.650.369 | 0,13 |
| 22.740.000 | Czech Republic Government Bond* | 5,00 % | 30.09.2030 | 1.095.192 | 0,08 |
| Tschechische Krone insgesamt | | | | 63.651.804 | 4,95 |
| Peso Dominikanische Republik | | | | | |
| 152.700.000 | Dominican Republic International Bond* | 9,75 % | 05.06.2026 | 2.632.083 | 0,20 |
| 170.800.000 | Dominican Republic International Bond* | 11,25 % | 15.09.2035 | 3.181.331 | 0,25 |
| 42.800.000 | Dominican Republic International Bond* | 13,63 % | 03.02.2033 | 898.919 | 0,07 |
| Peso Dominikanische Republik insgesamt | | | | 6.712.333 | 0,52 |
| Ghanaischer Cedi | | | | | |
| 7.520.645 | Republic of Ghana Government Bonds* | 8,35 % | 16.02.2027 | 351.096 | 0,03 |
| 7.526.192 | Republic of Ghana Government Bonds* | 8,50 % | 15.02.2028 | 303.909 | 0,02 |
| 7.029.623 | Republic of Ghana Government Bonds* | 8,65 % | 13.02.2029 | 251.578 | 0,02 |
| 7.034.801 | Republic of Ghana Government Bonds* | 8,80 % | 12.02.2030 | 228.773 | 0,02 |

Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 87,45 % (31. Dezember 2022: 92,36 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Ghanaischer Cedi (Fortsetzung) | | | | | |
| 7.039.979 | Republic of Ghana Government Bonds* | 8,95 % | 11.02.2031 | 211.825 | 0,02 |
| 7.045.156 | Republic of Ghana Government Bonds* | 9,10 % | 10.02.2032 | 200.438 | 0,02 |
| 7.050.334 | Republic of Ghana Government Bonds* | 9,25 % | 08.02.2033 | 192.372 | 0,01 |
| Ghanaischer Cedi insgesamt | | | | 1.739.991 | 0,14 |
| Ungarischer Forint | | | | | |
| 2.765.060.000 | Hungary Government Bond* | 3,00 % | 27.10.2027 | 7.285.452 | 0,57 |
| 712.080.000 | Hungary Government Bond* | 3,25 % | 22.10.2031 | 1.750.084 | 0,13 |
| 2.891.560.000 | Hungary Government Bond* | 4,50 % | 23.03.2028 | 7.967.633 | 0,62 |
| 4.784.820.000 | Hungary Government Bond* | 4,75 % | 24.11.2032 | 12.758.605 | 0,99 |
| 1.891.190.000 | Hungary Government Bond* | 9,50 % | 21.10.2026 | 5.924.773 | 0,46 |
| Ungarischer Forint insgesamt | | | | 35.686.547 | 2,77 |
| Indonesische Rupiah | | | | | |
| 72.466.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 6,13 % | 15.05.2028 | 4.649.284 | 0,36 |
| 237.648.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 6,38 % | 15.08.2028 | 15.417.635 | 1,20 |
| 12.550.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 6,38 % | 15.04.2032 | 803.979 | 0,06 |
| 11.000.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 6,38 % | 15.07.2037 | 705.634 | 0,05 |
| 156.481.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 6,63 % | 15.05.2033 | 10.199.159 | 0,79 |
| 173.110.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 6,63 % | 15.02.2034 | 11.252.678 | 0,88 |
| 156.972.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 6,88 % | 15.04.2029 | 10.359.202 | 0,81 |
| 64.288.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 7,00 % | 15.05.2027 | 4.246.883 | 0,33 |
| 138.710.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 7,00 % | 15.02.2033 | 9.344.162 | 0,73 |
| 159.990.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 7,13 % | 15.06.2038 | 10.890.429 | 0,85 |
| 79.350.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 7,13 % | 15.06.2042 | 5.363.710 | 0,42 |
| 73.178.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 7,13 % | 15.06.2043 | 4.942.185 | 0,38 |
| 97.706.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 7,50 % | 15.08.2032 | 6.722.932 | 0,52 |
| 79.493.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 7,50 % | 15.06.2035 | 5.470.933 | 0,43 |
| 20.280.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 7,50 % | 15.05.2038 | 1.408.724 | 0,11 |
| 60.000.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 7,50 % | 15.04.2040 | 4.162.574 | 0,32 |
| 39.425.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 8,25 % | 15.05.2029 | 2.761.363 | 0,21 |
| 73.362.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 8,25 % | 15.05.2036 | 5.357.619 | 0,42 |
| 58.565.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 8,38 % | 15.09.2026 | 3.990.548 | 0,31 |
| 88.577.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 8,38 % | 15.03.2034 | 6.434.302 | 0,50 |
| 98.837.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 8,75 % | 15.05.2031 | 7.184.925 | 0,56 |
| 33.258.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 9,00 % | 15.03.2029 | 2.390.308 | 0,19 |
| Indonesische Rupiah insgesamt | | | | 134.059.168 | 10,43 |
| Japanischer Yen | | | | | |
| 11.253.000 | Argentine Republic Government International Bond** | 0,67 % | 31.12.2038 | 15.017 | 0,00 |

Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 87,45 % (31. Dezember 2022: 92,36 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Japanischer Yen (Fortsetzung) | | | | | |
| 7.424.445 | Argentine Republic Government International Bond** | 4,33 % | 31.12.2033 | 9.367 | 0,00 |
| Japanischer Yen insgesamt | | | | 24.384 | 0,00 |
| Malaysischer Ringgit | | | | | |
| 20.322.000 | Malaysia Government Bond** | 2,63 % | 15.04.2031 | 4.086.389 | 0,32 |
| 27.226.000 | Malaysia Government Bond** | 3,50 % | 31.05.2027 | 5.908.346 | 0,46 |
| 3.710.000 | Malaysia Government Bond** | 3,58 % | 15.07.2032 | 792.423 | 0,06 |
| 31.882.000 | Malaysia Government Bond** | 3,73 % | 15.06.2028 | 6.960.246 | 0,54 |
| 24.319.000 | Malaysia Government Bond** | 3,76 % | 22.05.2040 | 5.065.762 | 0,39 |
| 31.512.000 | Malaysia Government Bond** | 3,83 % | 05.07.2034 | 6.816.107 | 0,53 |
| 5.637.000 | Malaysia Government Bond** | 3,84 % | 15.04.2033 | 1.227.457 | 0,10 |
| 80.535.000 | Malaysia Government Bond** | 3,90 % | 16.11.2027 | 17.701.926 | 1,38 |
| 17.138.000 | Malaysia Government Bond** | 3,90 % | 30.11.2026 | 3.770.405 | 0,29 |
| 31.229.000 | Malaysia Government Bond** | 4,07 % | 15.06.2050 | 6.674.794 | 0,52 |
| 9.113.000 | Malaysia Government Bond** | 4,23 % | 30.06.2031 | 2.035.670 | 0,16 |
| 16.765.000 | Malaysia Government Bond** | 4,25 % | 31.05.2035 | 3.740.730 | 0,29 |
| 22.000.000 | Malaysia Government Bond** | 4,50 % | 30.04.2029 | 4.979.348 | 0,39 |
| 4.800.000 | Malaysia Government Bond** | 4,50 % | 15.04.2030 | 1.089.403 | 0,08 |
| 20.974.000 | Malaysia Government Bond** | 4,64 % | 07.11.2033 | 4.902.771 | 0,38 |
| 67.418.000 | Malaysia Government Bond** | 4,70 % | 15.10.2042 | 15.798.895 | 1,23 |
| 6.300.000 | Malaysia Government Bond** | 4,76 % | 07.04.2037 | 1.478.936 | 0,12 |
| 46.510.000 | Malaysia Government Bond** | 4,89 % | 08.06.2038 | 11.117.093 | 0,86 |
| 4.791.000 | Malaysia Government Bond** | 4,94 % | 30.09.2043 | 1.139.540 | 0,09 |
| 26.306.000 | Malaysia Government Investment Issue** | 4,07 % | 30.09.2026 | 5.798.307 | 0,45 |
| 26.775.000 | Malaysia Government Investment Issue** | 4,37 % | 31.10.2028 | 6.002.130 | 0,47 |
| Malaysischer Ringgit insgesamt | | | | 117.086.678 | 9,11 |
| Mexikanischer Peso | | | | | |
| 137.440.000 | Mexican Bonos* | 5,50 % | 04.03.2027 | 7.280.923 | 0,57 |
| 261.449.400 | Mexican Bonos* | 7,50 % | 03.06.2027 | 14.632.027 | 1,14 |
| 225.050.000 | Mexican Bonos* | 7,50 % | 26.05.2033 | 12.132.788 | 0,94 |
| 410.643.600 | Mexican Bonos* | 7,75 % | 29.05.2031 | 22.632.017 | 1,76 |
| 171.430.200 | Mexican Bonos* | 7,75 % | 13.11.2042 | 8.912.407 | 0,69 |
| 90.673.600 | Mexican Bonos* | 8,00 % | 07.11.2047 | 4.789.646 | 0,37 |
| 453.064.600 | Mexican Bonos* | 8,50 % | 31.05.2029 | 26.196.923 | 2,04 |
| 201.443.000 | Mexican Bonos* | 8,50 % | 18.11.2038 | 11.355.487 | 0,88 |
| Mexikanischer Peso insgesamt | | | | 107.932.218 | 8,39 |
| Peruanischer Sol | | | | | |
| 24.441.000 | Fondo MIVIVIENDA SA* | 7,00 % | 14.02.2024 | 6.569.352 | 0,51 |

Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 87,45 % (31. Dezember 2022: 92,36 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Peruanischer Sol (Fortsetzung) | | | | | |
| 7.536.000 | Peru Government Bond* | 5,35 % | 12.08.2040 | 1.745.018 | 0,14 |
| 22.336.000 | Peru Government Bond* | 5,40 % | 12.08.2034 | 5.456.098 | 0,42 |
| 35.779.000 | Peru Government Bond* | 6,15 % | 12.08.2032 | 9.442.084 | 0,73 |
| 23.856.000 | Peru Government Bond* | 7,30 % | 12.08.2033 | 6.759.022 | 0,53 |
| 8.187.000 | Peruvian Government International Bond* | 5,40 % | 12.08.2034 | 1.999.869 | 0,15 |
| 23.052.000 | Peruvian Government International Bond** | 6,90 % | 12.08.2037 | 6.282.739 | 0,49 |
| Peruanischer Sol insgesamt | | | | 38.254.182 | 2,97 |
| Philippinischer Peso | | | | | |
| 262.860.000 | Philippine Government Bond* | 6,75 % | 15.09.2032 | 4.998.061 | 0,39 |
| Philippinischer Peso insgesamt | | | | 4.998.061 | 0,39 |
| Polnischer Zloty | | | | | |
| 19.507.000 | Republic of Poland Government Bond* | 0,25 % | 25.10.2026 | 4.362.147 | 0,34 |
| 31.927.000 | Republic of Poland Government Bond** | 1,25 % | 25.10.2030 | 6.429.967 | 0,50 |
| 114.491.000 | Republic of Poland Government Bond* | 1,75 % | 25.04.2032 | 22.659.391 | 1,76 |
| 86.365.000 | Republic of Poland Government Bond* | 2,50 % | 25.07.2026 | 20.690.509 | 1,61 |
| 53.964.000 | Republic of Poland Government Bond* | 2,50 % | 25.07.2027 | 12.689.477 | 0,98 |
| 62.747.000 | Republic of Poland Government Bond* | 2,75 % | 25.10.2029 | 14.254.807 | 1,11 |
| 29.868.000 | Republic of Poland Government Bond* | 6,00 % | 25.10.2033 | 8.060.973 | 0,63 |
| 122.011.000 | Republic of Poland Government Bond* | 7,50 % | 25.07.2028 | 34.167.726 | 2,66 |
| Polnischer Zloty insgesamt | | | | 123.314.997 | 9,59 |
| Rumänischer neuer Leu | | | | | |
| 66.350.000 | Romania Government Bond* | 2,50 % | 25.10.2027 | 12.930.466 | 1,01 |
| 3.615.000 | Romania Government Bond* | 3,65 % | 24.09.2031 | 676.963 | 0,05 |
| 14.600.000 | Romania Government Bond* | 4,15 % | 24.10.2030 | 2.892.282 | 0,22 |
| 2.540.000 | Romania Government Bond* | 4,75 % | 11.10.2034 | 497.902 | 0,04 |
| 35.830.000 | Romania Government Bond** | 4,85 % | 25.07.2029 | 7.471.221 | 0,58 |
| 5.465.000 | Romania Government Bond* | 5,00 % | 12.02.2029 | 1.150.093 | 0,09 |
| 8.305.000 | Romania Government Bond* | 6,70 % | 25.02.2032 | 1.902.178 | 0,15 |
| 4.615.000 | Romania Government Bond* | 7,90 % | 24.02.2038 | 1.185.285 | 0,09 |
| 29.040.000 | Romania Government Bond* | 8,25 % | 29.09.2032 | 7.295.740 | 0,57 |
| 17.355.000 | Romania Government Bond* | 8,75 % | 30.10.2028 | 4.250.242 | 0,33 |
| Rumänischer neuer Leu insgesamt | | | | 40.252.372 | 3,13 |
| Serbischer Dinar | | | | | |
| 115.190.000 | Serbia Treasury Bonds* | 4,50 % | 11.01.2026 | 1.069.087 | 0,08 |
| 80.900.000 | Serbia Treasury Bonds* | 4,50 % | 20.08.2032 | 677.470 | 0,05 |

Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 87,45 % (31. Dezember 2022: 92,36 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Serbischer Dinar (Fortsetzung) | | | | | |
| 198.550.000 | Serbia Treasury Bonds* | 5,88 % | 08.02.2028 | 1.902.398 | 0,15 |
| Serbischer Dinar insgesamt | | | | 3.648.955 | 0,28 |
| Südafrikanischer Rand | | | | | |
| 477.597.049 | Republic of South Africa Government Bond* | 6,25 % | 31.03.2036 | 17.167.378 | 1,33 |
| 107.856.522 | Republic of South Africa Government Bond* | 6,50 % | 28.02.2041 | 3.569.955 | 0,28 |
| 398.083.419 | Republic of South Africa Government Bond* | 7,00 % | 28.02.2031 | 18.231.839 | 1,42 |
| 499.584.549 | Republic of South Africa Government Bond* | 8,50 % | 31.01.2037 | 21.405.303 | 1,66 |
| 339.553.208 | Republic of South Africa Government Bond* | 8,75 % | 31.01.2044 | 13.793.798 | 1,07 |
| 180.529.026 | Republic of South Africa Government Bond* | 8,75 % | 28.02.2048 | 7.282.366 | 0,57 |
| 312.376.153 | Republic of South Africa Government Bond* | 8,88 % | 28.02.2035 | 14.442.326 | 1,12 |
| 347.139.572 | Republic of South Africa Government Bond* | 9,00 % | 31.01.2040 | 14.884.054 | 1,16 |
| 198.727.464 | Republic of South Africa Government Bond* | 10,50 % | 21.12.2026 | 11.386.825 | 0,89 |
| Südafrikanischer Rand insgesamt | | | | 122.163.844 | 9,50 |
| Thailändischer Baht | | | | | |
| 52.597.000 | Thailand Government Bond** | 1,60 % | 17.06.2035 | 1.371.700 | 0,11 |
| 275.646.000 | Thailand Government Bond** | 2,00 % | 17.06.2042 | 6.892.770 | 0,54 |
| 109.097.000 | Thailand Government Bond** | 2,13 % | 17.12.2026 | 3.175.339 | 0,25 |
| 58.000.000 | Thailand Government Bond** | 2,40 % | 17.03.2029 | 1.694.561 | 0,13 |
| 153.400.000 | Thailand Government Bond** | 2,65 % | 17.06.2028 | 4.536.441 | 0,35 |
| 83.000 | Thailand Government Bond** | 2,88 % | 17.12.2028 | 2.480 | 0,00 |
| 27.836.000 | Thailand Government Bond** | 2,88 % | 17.06.2046 | 747.975 | 0,06 |
| 315.519.000 | Thailand Government Bond** | 3,30 % | 17.06.2038 | 9.652.944 | 0,75 |
| 350.777.000 | Thailand Government Bond** | 3,35 % | 17.06.2033 | 10.833.160 | 0,84 |
| 171.000.000 | Thailand Government Bond** | 3,39 % | 17.06.2037 | 5.307.504 | 0,41 |
| 196.399.000 | Thailand Government Bond** | 3,40 % | 17.06.2036 | 6.079.309 | 0,47 |
| 91.900.000 | Thailand Government Bond** | 3,45 % | 17.06.2043 | 2.825.287 | 0,22 |
| 234.450.000 | Thailand Government Bond** | 3,78 % | 25.06.2032 | 7.424.337 | 0,58 |
| 5.000 | Thailand Government Bond** | 3,85 % | 12.12.2025 | 151 | 0,00 |
| 136.225.000 | Thailand Government Bond** | 4,88 % | 22.06.2029 | 4.471.500 | 0,35 |
| Thailändischer Baht insgesamt | | | | 65.015.458 | 5,06 |
| Türkische Lira | | | | | |
| 350.599.807 | Turkey Government Bond* | 1,50 % | 18.06.2025 | 12.476.481 | 0,97 |
| 55.104.752 | Türkiye Government Bond* | 17,80 % | 13.07.2033 | 1.464.659 | 0,11 |
| 175.360.179 | Türkiye Government Bond* | 26,20 % | 05.10.2033 | 6.175.072 | 0,48 |
| Türkische Lira insgesamt | | | | 20.116.212 | 1,56 |

Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|----------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 87,45 % (31. Dezember 2022: 92,36 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Uganda-Schilling | | | | | |
| 22.942.900.000 | Republic of Uganda Government Bonds* | 14,25 % | 22.06.2034 | 5.747.019 | 0,45 |
| Uganda-Schilling insgesamt | | | | 5.747.019 | 0,45 |
| US-Dollar | | | | | |
| 27.119.632 | Argentine Republic Government International Bond* | 0,75 % | 09.07.2030 | 10.942.954 | 0,85 |
| US-Dollar insgesamt | | | | 10.942.954 | 0,85 |
| Uruguayischer Peso | | | | | |
| 21.091.551 | Uruguay Government International Bond* | 8,25 % | 21.05.2031 | 500.924 | 0,04 |
| 493.856.000 | Uruguay Government International Bond* | 8,50 % | 15.03.2028 | 12.211.886 | 0,95 |
| 44.097.716 | Uruguay Government International Bond* | 9,75 % | 20.07.2033 | 1.143.276 | 0,09 |
| Uruguayischer Peso insgesamt | | | | 13.856.086 | 1,08 |
| Sambischer Kwacha | | | | | |
| 178.877.000 | Zambia Government Bond* | 13,00 % | 25.01.2031 | 4.493.148 | 0,35 |
| Sambischer Kwacha insgesamt | | | | 4.493.148 | 0,35 |
| Staatsanleihen insgesamt | | | | 1.124.421.834 | 87,45 |
| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | | | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Investmentfonds 1,26 % (31. Dezember 2022: 1,09 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 1.595.000 | Neuberger Berman China Bond Fund | | | 16.173.300 | 1,26 |
| Investmentfonds insgesamt ^u | | | | 16.173.300 | 1,26 |
| Anlagen insgesamt | | | | 1.215.761.884 | 94,55 |

Devisenterminkontrakte 1,33 % (31. Dezember 2022: 1,08 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeits- datum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettover- mögens |
|-----------------------|------------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| 89.346.912 BRL | 17.501.222 US\$ | 25.01.2024 | Citibank NA | 2 | 866.427 | 0,07 |
| 14.702.911 BRL | 2.969.457 US\$ | 03.04.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | 31.891 | 0,00 |
| 7.630.442 BRL | 1.546.687 US\$ | 03.04.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 10.938 | 0,00 |
| 606.214.769 BRL | 122.122.234 US\$ | 03.04.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 1.626.180 | 0,13 |
| 52.066.255 BRL | 10.646.277 US\$ | 25.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | 57.335 | 0,01 |
| 22.452.469 BRL | 4.457.437 US\$ | 25.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 158.268 | 0,01 |
| 5.495.712.525 CLP | 6.207.460 US\$ | 20.03.2024 | Morgan Stanley | 1 | 60.472 | 0,01 |
| 91.410.500 CNY | 12.872.231 US\$ | 20.03.2024 | Barclays Bank Plc | 1 | 34.296 | 0,00 |
| 24.087.608 CNY | 3.393.660 US\$ | 20.02.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 475 | 0,00 |
| 91.410.499 CNY | 12.872.836 US\$ | 20.03.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | 33.690 | 0,00 |
| 405.622.494 EGP | 11.815.395 US\$ | 17.01.2024 | Citibank NA | 1 | 216.954 | 0,02 |

Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 1,33 % (31. Dezember 2022: 1,08 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 13.877.676 € | 340.286.723 CZK | 20.03.2024 | Barclays Bank Plc | 1 | 183.721 | 0,01 |
| 6.425.553 € | 6.998.858 US\$ | 04.01.2024 | Barclays Bank Plc | 3 | 99.404 | 0,01 |
| 11.465.944 € | 12.560.085 US\$ | 04.01.2024 | Citibank NA | 2 | 106.262 | 0,01 |
| 3.742.911 € | 16.290.079 PLN | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | 9.279 | 0,00 |
| 10.765.910 € | 11.802.271 US\$ | 04.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | 90.753 | 0,01 |
| 7.075.431 € | 30.779.576 PLN | 20.03.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 21.213 | 0,00 |
| 3.761.544 € | 4.118.730 US\$ | 04.01.2024 | Morgan Stanley | 1 | 36.621 | 0,00 |
| 751.750.972 HUF | 1.949.941 € | 06.02.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 4.983 | 0,00 |
| 718.022.907 HUF | 1.863.329 € | 06.02.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 3.792 | 0,00 |
| 86.720.911.474 IDR | 5.495.796 US\$ | 07.02.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | 128.964 | 0,01 |
| 19.439.282.518 IDR | 1.260.736 US\$ | 07.02.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 106 | 0,00 |
| 21.637.061.564 IDR | 1.395.199 US\$ | 20.03.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | 7.880 | 0,00 |
| 35.713.244.621 IDR | 2.301.334 US\$ | 07.02.2024 | Morgan Stanley | 1 | 15.045 | 0,00 |
| 6.912.528 ILS | 1.864.228 US\$ | 25.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 56.284 | 0,01 |
| 467.429.128 INR | 5.603.181 US\$ | 08.02.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 4.975 | 0,00 |
| 8.027.103.141 KRW | 6.187.689 US\$ | 20.03.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 31.111 | 0,00 |
| 7.538.158.009 KRW | 5.720.247 US\$ | 16.01.2024 | Morgan Stanley | 1 | 95.584 | 0,01 |
| 8.137.399.304 KRW | 6.269.028 US\$ | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 35.221 | 0,00 |
| 510.747.927 MXN | 28.997.615 US\$ | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | 783.796 | 0,06 |
| 23.019.197 MXN | 1.329.903 US\$ | 20.03.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | 12.333 | 0,00 |
| 86.307.125 MXN | 4.882.011 US\$ | 20.03.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | 150.506 | 0,01 |
| 25.982.566 MYR | 5.497.211 US\$ | 23.01.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | 175.548 | 0,01 |
| 26.619.162 MYR | 5.702.721 US\$ | 11.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 103.799 | 0,01 |
| 64.302.318 MYR | 13.862.740 US\$ | 20.03.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 237.462 | 0,02 |
| 52.926.276 MYR | 11.415.153 US\$ | 07.03.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 181.144 | 0,01 |
| 41.597.527 PEN | 10.878.868 US\$ | 18.01.2024 | Barclays Bank Plc | 1 | 350.341 | 0,03 |
| 308.471.592 PHP | 5.505.236 US\$ | 06.02.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | 63.413 | 0,01 |
| 15.708.240 RON | 3.148.499 € | 19.01.2024 | Citibank NA | 1 | 6.977 | 0,00 |
| 19.824.355 RON | 3.974.423 € | 19.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 7.804 | 0,00 |
| 10.753.023 RON | 2.157.713 € | 19.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 2.102 | 0,00 |
| 7.482.812 SGD | 5.501.461 US\$ | 22.01.2024 | Morgan Stanley | 1 | 176.503 | 0,01 |
| 1.093.020.617 THB | 31.386.821 US\$ | 20.03.2024 | Goldman Sachs International | 3 | 851.555 | 0,07 |
| 403.265.137 THB | 11.496.700 US\$ | 08.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 322.696 | 0,03 |
| 204.811.305 THB | 5.732.515 US\$ | 16.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 274.968 | 0,02 |
| 680.098.291 THB | 19.534.354 US\$ | 20.03.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 524.979 | 0,04 |
| 52.986.401 THB | 1.527.065 US\$ | 20.03.2024 | UBS AG | 1 | 35.756 | 0,00 |
| 383.320.481 TWD | 12.048.420 US\$ | 12.01.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | 528.976 | 0,04 |
| 181.961.109 TWD | 5.808.443 US\$ | 08.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 148.608 | 0,01 |
| 3.853.075 US\$ | 212.982.598 PHP | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | 8.362 | 0,00 |
| 6.969.417 US\$ | 127.975.834 ZAR | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | 18.814 | 0,00 |
| 5.897.297 US\$ | 7.636.292.545 KRW | 16.01.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | 5.755 | 0,00 |

Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 1,33 % (31. Dezember 2022: 1,08 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 3.656.499 US\$ | 3.288.127 € | 05.02.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 19.182 | 0,00 |
| 230.517.187 UYU | 5.755.735 US\$ | 27.03.2024 | Citibank NA | 1 | 100.901 | 0,01 |
| 191.331.729 UYU | 4.774.097 US\$ | 09.02.2024 | Citibank NA | 2 | 113.672 | 0,01 |
| 45.670.724 UYU | 1.127.672 US\$ | 09.02.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 39.034 | 0,00 |
| 173.855.725 UYU | 4.296.952 US\$ | 09.02.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | 144.374 | 0,01 |
| 142.061.319 ZAR | 7.469.443 US\$ | 20.03.2024 | Morgan Stanley | 2 | 246.168 | 0,02 |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> | | | | | | |
| 734.831 AUD | 494.629 US\$ | 14.03.2024 | UBS AG | 1 | 7.875 | 0,00 |
| 30.232.349 AUD | 19.960.970 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 13 | 713.012 | 0,06 |
| 9.767 US\$ | 14.227 AUD | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | 39 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 2.781.056 € | 3.014.565 US\$ | 14.03.2024 | Goldman Sachs International | 2 | 66.380 | 0,01 |
| 25.064.872 € | 27.169.744 US\$ | 14.03.2024 | UBS AG | 1 | 597.952 | 0,05 |
| 1.167.042 € | 1.279.363 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 8 | 13.526 | 0,00 |
| 9.426 US\$ | 8.464 € | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | 49 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 8.924 £ | 11.351 US\$ | 14.03.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 29 | 0,00 |
| 358.598 £ | 452.237 US\$ | 14.03.2024 | UBS AG | 2 | 5.068 | 0,00 |
| 10.668 £ | 13.518 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | 87 | 0,00 |
| 120 US\$ | 94 £ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 0 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i> | | | | | | |
| 181.022 SEK | 17.725 US\$ | 14.03.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 288 | 0,00 |
| 1.113.655.977 SEK | 106.652.655 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 4 | 4.165.171 | 0,32 |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i> | | | | | | |
| 829.746 SGD | 621.662 US\$ | 14.03.2024 | Goldman Sachs International | 3 | 9.443 | 0,00 |
| 13.950 SGD | 10.471 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 5 | 139 | 0,00 |
| 4.013 US\$ | 5.266 SGD | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 8 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i> | | | | | | |
| 247 US\$ | 4.552 ZAR | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | 0 | 0,00 |
| 967.576.824 ZAR | 50.713.365 US\$ | 14.03.2024 | Goldman Sachs International | 3 | 1.865.751 | 0,14 |
| 10.158.611 ZAR | 544.222 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 11 | 7.807 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | 17.116.276 | 1,33 |

Futures-Kontrakte 0,03 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---|--------------------------------|----------------------|
| 43 | South Korea 10-Year Bond Future March 2024 | 51.083 | 0,01 |
| 561 | South Korea 3-Year Bond Future March 2024 | 139.390 | 0,01 |
| 133 | US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2024 | 123.195 | 0,01 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten [‡] | | 313.668 | 0,03 |

Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Zinsswap-Kontrakte 0,89 % (31. Dezember 2022: 0,64 %)

| | Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei | Erhalt/(Zahlung) [#] | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|----------------|------------|--|-------------------------------|-----------------|--------------------|--------------------------------|----------------------|
| MXN | 512.441.055 | 31.08.2029 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | Erhalt | 6,92 % | 28D MXIBTIIE | 2.143.573 | 0,17 |
| BRL | 105.671.287 | 04.01.2027 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | (Zahlung) | 12,76 % | 1D BROIS | 2.099.472 | 0,16 |
| BRL | 86.253.227 | 04.01.2027 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | (Zahlung) | 12,67 % | 1D BROIS | 1.647.825 | 0,13 |
| BRL | 70.829.782 | 04.01.2027 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | (Zahlung) | 12,68 % | 1D BROIS | 1.362.469 | 0,11 |
| CZK | 251.860.308 | 11.04.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 4,70 % | 6M PRIBOR | 469.675 | 0,04 |
| BRL | 24.637.956 | 02.01.2030 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | (Zahlung) | 11,50 % | 1D BROIS | 435.223 | 0,03 |
| BRL | 74.083.362 | 02.01.2026 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 11,06 % | 1D BROIS | 399.634 | 0,03 |
| BRL | 86.110.250 | 02.01.2026 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | (Zahlung) | 11,57 % | 1D BROIS | 363.178 | 0,03 |
| COP | 56.328.682.161 | 31.01.2027 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | Erhalt | 7,14 % | 1D COOVIBR | 279.907 | 0,02 |
| BRL | 67.694.701 | 02.01.2026 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 10,59 % | 1D BROIS | 242.667 | 0,02 |
| COP | 85.928.260.876 | 13.04.2024 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | Erhalt | 8,37 % | 1D COOVIBR | 229.249 | 0,02 |
| BRL | 65.515.347 | 02.01.2026 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | (Zahlung) | 11,40 % | 1D BROIS | 225.783 | 0,02 |
| CZK | 136.144.314 | 12.10.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 4,39 % | 6M PRIBOR | 212.987 | 0,02 |
| MXN | 128.272.271 | 30.10.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 9,26 % | 28D MXIBTIIE | 203.043 | 0,01 |
| BRL | 30.505.879 | 02.01.2031 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 10,49 % | 1D BROIS | 177.545 | 0,01 |
| HUF | 559.561.178 | 10.02.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 8,72 % | 6M BUBOR | 176.022 | 0,01 |
| COP | 16.091.111.994 | 06.01.2027 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | Erhalt | 6,40 % | 1D COOVIBR | 162.171 | 0,01 |
| BRL | 34.373.160 | 02.01.2031 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 10,43 % | 1D BROIS | 100.729 | 0,01 |
| MXN | 128.662.190 | 17.08.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 8,94 % | 28D MXIBTIIE | 93.547 | 0,01 |
| MXN | 256.541.706 | 20.03.2025 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | Erhalt | 10,05 % | 28D MXIBTIIE | 86.351 | 0,01 |
| MXN | 128.662.192 | 17.08.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 8,91 % | 28D MXIBTIIE | 84.858 | 0,01 |
| CZK | 953.385.065 | 22.12.2025 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 4,47 % | 6M PRIBOR | 82.308 | 0,01 |
| COP | 7.078.194.753 | 07.01.2027 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | Erhalt | 6,45 % | 1D COOVIBR | 68.709 | 0,00 |
| CZK | 39.819.822 | 25.07.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 4,19 % | 6M PRIBOR | 44.041 | 0,00 |
| CNY | 91.100.000 | 29.08.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 2,30 % | 7D CNRR | 31.973 | 0,00 |
| MXN | 132.917.273 | 25.03.2026 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 9,33 % | 28D MXIBTIIE | 31.571 | 0,00 |
| CZK | 7.526.455 | 16.10.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 4,30 % | 6M PRIBOR | 10.339 | 0,00 |
| CNY | 72.600.000 | 11.12.2026 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 2,25 % | 7D CNRR | 7.365 | 0,00 |
| CNY | 109.400.000 | 16.08.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 2,28 % | 7D CNRR | 4.457 | 0,00 |
| MYR | 72.766.553 | 20.12.2025 | Goldman Sachs International | (Zahlung) | 3,50 % | 3M KLIBOR | 3.085 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten [∞] | | | | | | | 11.479.756 | 0,89 |

[#]Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

¹Zentral abgewickelter Swap.

| | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|----------------------|----------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 1.244.671.584 | 96,80 |

Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,96 %) (31. Dezember 2022: (0,69 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 83.310.361 CNY | 11.708.573 US\$ | 10.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | (2.583) | (0,00) |
| 242.779.120 EGP | 5.530.276 US\$ | 02.04.2024 | Citibank NA | 1 | (31.315) | (0,00) |
| 42.843.374 EGP | 982.646 US\$ | 02.04.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (12.241) | (0,00) |
| 3.020.865 € | 15.067.428 RON | 19.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (5.800) | (0,00) |
| 4.357.630.352 HUF | 11.371.783 € | 06.02.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (47.091) | (0,00) |
| 284.067.272 KRW | 222.035 US\$ | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | (1.961) | (0,00) |
| 23.840.128 PLN | 5.469.656 € | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | (4.711) | (0,00) |
| 8.158.717 PLN | 1.873.243 € | 20.03.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | (3.145) | (0,00) |
| 3.700.801 US\$ | 3.382.238 € | 05.02.2024 | Barclays Bank Plc | 1 | (40.621) | (0,00) |
| 13.925.691 US\$ | 12.840.487 € | 04.01.2024 | Barclays Bank Plc | 3 | (259.103) | (0,02) |
| 623.007 US\$ | 21.566.583 THB | 20.03.2024 | BNP Paribas | 1 | (13.094) | (0,00) |
| 1.453.941 US\$ | 25.564.577 MXN | 20.03.2024 | BNP Paribas | 1 | (36.715) | (0,00) |
| 12.929.617 US\$ | 11.774.931 € | 05.02.2024 | Citibank NA | 2 | (95.778) | (0,01) |
| 8.471.185 US\$ | 32.553.069 PEN | 18.01.2024 | Citibank NA | 1 | (316.482) | (0,03) |
| 5.949.611 US\$ | 207.354.063 THB | 16.01.2024 | Citibank NA | 1 | (132.456) | (0,01) |
| 5.818.921 US\$ | 7.930.288 SGD | 22.01.2024 | Citibank NA | 1 | (198.587) | (0,02) |
| 2.181.044 US\$ | 38.379.551 MXN | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | (56.845) | (0,00) |
| 10.105.941 US\$ | 362.779.120 EGP | 17.01.2024 | Citibank NA | 2 | (655.505) | (0,05) |
| 377.543 US\$ | 492.860.026 KRW | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | (4.288) | (0,00) |
| 10.320.041 US\$ | 75.309.284 CNY | 10.01.2024 | Citibank NA | 1 | (261.713) | (0,02) |
| 4.202.336 US\$ | 20.641.411 BRL | 03.04.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | (11.257) | (0,00) |
| 2.054.344 US\$ | 35.600.000 MXN | 20.03.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | (21.471) | (0,00) |
| 7.623.768 US\$ | 38.626.278 BRL | 25.01.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | (316.897) | (0,03) |
| 1.840.415 US\$ | 9.235.129 BRL | 03.04.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (44.779) | (0,00) |
| 33.858.552 US\$ | 138.010.843.904 COP | 20.03.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (1.216.392) | (0,10) |
| 23.446.102 US\$ | 95.078.396.855 COP | 01.02.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (938.486) | (0,07) |
| 12.868.352 US\$ | 11.903.730 € | 04.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (281.614) | (0,02) |
| 3.574.401 US\$ | 17.844.517 BRL | 03.04.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | (68.253) | (0,01) |
| 1.764.501 US\$ | 8.184.813 MYR | 20.03.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | (30.264) | (0,00) |
| 1.329.176 US\$ | 1.734.893.361 KRW | 20.03.2024 | HSBC Bank Plc | 2 | (14.890) | (0,00) |
| 2.730.407 US\$ | 42.377.913.324 IDR | 20.03.2024 | HSBC Bank Plc | 2 | (17.634) | (0,00) |
| 10.898.021 US\$ | 443.603.947 UYU | 09.02.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | (434.306) | (0,03) |
| 5.754.279 US\$ | 27.258.019 MYR | 23.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (196.948) | (0,02) |
| 2.082.203 US\$ | 1.834.879.089 CLP | 20.03.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (10.500) | (0,00) |
| 5.143.490 US\$ | 26.065.048 BRL | 25.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (214.878) | (0,02) |
| 1.224.096 US\$ | 42.843.374 EGP | 17.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (46.806) | (0,00) |
| 2.330.680 US\$ | 10.801.536 MYR | 20.03.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (37.879) | (0,00) |
| 11.462.572 US\$ | 214.755.317 ZAR | 20.03.2024 | Morgan Stanley | 1 | (201.185) | (0,02) |
| 11.376.285 US\$ | 42.598.500 PEN | 18.01.2024 | Morgan Stanley | 1 | (123.135) | (0,01) |
| 8.342.840 US\$ | 7.674.733 € | 04.01.2024 | Morgan Stanley | 3 | (135.382) | (0,01) |

Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (0,96 %) (31. Dezember 2022: (0,69 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 1.754.748 US\$ | 27.225.091.101 IDR | 07.02.2024 | Morgan Stanley | 1 | (11.085) | (0,00) |
| 5.857.072 US\$ | 181.652.983 TWD | 08.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | (89.892) | (0,01) |
| 13.148.642 US\$ | 94.639.458 CNY | 20.02.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | (186.809) | (0,02) |
| 10.091.436 US\$ | 157.933.993.840 IDR | 20.03.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | (149.964) | (0,01) |
| 11.988.992 US\$ | 383.659.740 TWD | 12.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | (599.535) | (0,05) |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> | | | | | | |
| 404.387 AUD | 277.287 US\$ | 14.03.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (753) | (0,00) |
| 200 AUD | 138 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (1) | (0,00) |
| 317.961 US\$ | 477.366 AUD | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 15 | (8.481) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 396.855 € | 440.705 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | (1.056) | (0,00) |
| 295.578 US\$ | 271.646 € | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 12 | (5.360) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 2.876 US\$ | 2.289 £ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | (43) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i> | | | | | | |
| 101.815 SEK | 10.232 US\$ | 14.03.2024 | UBS AG | 1 | (101) | (0,00) |
| 250 SEK | 25 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | (0) | (0,00) |
| 5.033 US\$ | 52.411 SEK | 14.03.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (183) | (0,00) |
| 105.945.439 US\$ | 1.106.270.764 SEK | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 6 | (4.137.497) | (0,33) |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i> | | | | | | |
| 9.526 SGD | 7.246 US\$ | 14.03.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (0) | (0,00) |
| 69.288 US\$ | 92.492 SGD | 14.03.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (1.062) | (0,00) |
| 3.024 US\$ | 4.043 SGD | 14.03.2024 | UBS AG | 1 | (52) | (0,00) |
| 22.881 US\$ | 30.574 SGD | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 4 | (373) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i> | | | | | | |
| 14.233.048 US\$ | 271.729.490 ZAR | 14.03.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (533.011) | (0,04) |
| 638.354 US\$ | 11.992.589 ZAR | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 18 | (13.335) | (0,00) |
| 31.806 ZAR | 1.730 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (1) | (0,00) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | (12.281.584) | (0,96) |

Futures-Kontrakte (0,06 %) (31. Dezember 2022: (0,05 %))

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|--|---------------------------------|----------------------|
| (106) | Euro-BOBL Future March 2024 | (4.684) | (0,00) |
| (55) | US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2024 | (711.992) | (0,06) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten * | | (716.676) | (0,06) |

Zinsswap-Kontrakte (1,16 %) (31. Dezember 2022: (3,40 %))

| Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei | Erhalt/(Zahlung) [#] | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------|------------|-------------------------------|-------------------------------|-----------------|--------------------|---------------------------------|----------------------|
| 1.221.633.954 | 19.12.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 6,21 % | 1D MIBOR | (403) | (0,00) |

Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Zinsswap-Kontrakte (1,16 %) (31. Dezember 2022: (3,40 %)) (Fortsetzung)

| | Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei | Erhalt/(Zahlung) [#] | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|----------------|------------|--|-------------------------------|-----------------|--------------------|---------------------------------|----------------------|
| CLP | 6.932.372.858 | 24.10.2033 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 6,12 % | 1D CLICP | (860) | (0,00) |
| BRL | 427.249 | 02.01.2024 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | (Zahlung) | 11,66 % | 1D BROIS | (2.388) | (0,00) |
| CLP | 45.161.320 | 24.08.2030 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | (Zahlung) | 2,15 % | 1D CLICP | (7.739) | (0,00) |
| PLN | 29.499.301 | 07.11.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 4,51 % | 6M WIBOR | (34.010) | (0,00) |
| BRL | 29.285.776 | 02.01.2029 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 10,30 % | 1D BROIS | (54.647) | (0,00) |
| BRL | 136.854.801 | 02.01.2026 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 10,00 % | 1D BROIS | (74.233) | (0,01) |
| COP | 26.779.695.017 | 02.06.2025 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | Erhalt | 10,28 % | 1D COOVIBR | (78.474) | (0,01) |
| PLN | 22.853.707 | 10.10.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 4,76 % | 6M WIBOR | (85.681) | (0,01) |
| MXN | 328.685.527 | 03.02.2028 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | (Zahlung) | 8,58 % | 28D MXIBTIE | (91.886) | (0,01) |
| PLN | 29.194.460 | 01.12.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 4,72 % | 6M WIBOR | (95.610) | (0,01) |
| PLN | 8.775.179 | 15.05.2033 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 5,20 % | 6M WIBOR | (122.173) | (0,01) |
| PLN | 8.775.181 | 15.05.2033 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 5,22 % | 6M WIBOR | (125.119) | (0,01) |
| MXN | 34.061.309 | 08.12.2025 | Goldman Sachs International | (Zahlung) | 6,21 % | 28D MXIBTIE | (127.108) | (0,01) |
| PLN | 15.280.123 | 02.10.2033 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 4,99 % | 6M WIBOR | (153.978) | (0,01) |
| COP | 53.508.123.529 | 05.06.2025 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | Erhalt | 10,27 % | 1D COOVIBR | (157.206) | (0,01) |
| COP | 8.472.548.430 | 11.08.2032 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | Erhalt | 9,02 % | 1D COOVIBR | (190.036) | (0,01) |
| PLN | 18.527.328 | 03.10.2033 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 5,01 % | 6M WIBOR | (194.172) | (0,01) |
| MXN | 60.000.000 | 08.04.2026 | Goldman Sachs International | (Zahlung) | 5,95 % | 28D MXIBTIE | (258.986) | (0,02) |
| MXN | 76.391.828 | 28.05.2026 | JPMorgan Chase Bank | (Zahlung) | 6,16 % | 28D MXIBTIE | (317.630) | (0,02) |
| MXN | 75.000.000 | 18.06.2026 | JPMorgan Chase Bank | (Zahlung) | 6,13 % | 28D MXIBTIE | (317.726) | (0,02) |
| MXN | 242.308.506 | 07.01.2028 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | (Zahlung) | 8,04 % | 28D MXIBTIE | (337.123) | (0,03) |
| MXN | 90.000.000 | 21.05.2026 | JPMorgan Chase Bank | (Zahlung) | 6,33 % | 28D MXIBTIE | (353.615) | (0,03) |
| MXN | 94.552.835 | 05.03.2026 | Goldman Sachs International | (Zahlung) | 6,17 % | 28D MXIBTIE | (376.694) | (0,03) |
| MXN | 95.000.000 | 16.09.2026 | Goldman Sachs International | (Zahlung) | 6,38 % | 28D MXIBTIE | (384.564) | (0,03) |
| BRL | 21.212.260 | 02.01.2031 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 11,54 % | 1D BROIS | (459.800) | (0,04) |
| PLN | 11.813.679 | 28.10.2032 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 7,32 % | 6M WIBOR | (612.444) | (0,05) |
| CLP | 29.962.297.165 | 14.09.2024 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | Erhalt | 9,80 % | 1D CLICP | (743.483) | (0,06) |
| MXN | 141.097.429 | 08.10.2038 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 9,77 % | 28D MXIBTIE | (894.141) | (0,07) |
| BRL | 40.209.304 | 02.01.2025 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | (Zahlung) | 6,82 % | 1D BROIS | (920.503) | (0,07) |
| BRL | 107.195.155 | 02.01.2024 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | (Zahlung) | 5,76 % | 1D BROIS | (2.617.874) | (0,20) |
| BRL | 136.490.816 | 01.07.2024 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | (Zahlung) | 5,92 % | 1D BROIS | (4.787.449) | (0,37) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten [∞] | | | | | | | (14.977.755) | (1,16) |

[#]Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

¹Zentral abgewickelter Swap.

Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|---|----------------------|------------------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (27.976.015) | (2,18) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | 1.216.695.569 | 94,62 |
| Sonstiges Nettovermögen | 69.172.078 | 5,38 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | 1.285.867.647 | 100,00 |

| Portfolioanalyse | | US\$ | % des Gesamtver- mögens |
|--------------------------|---|----------------------|-------------------------------|
| * | Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 870.284.155 | 65,81 |
| ** | Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 329.304.429 | 24,90 |
| μ | Investmentfonds | 16.173.300 | 1,22 |
| ± | Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | (403.008) | (0,03) |
| ∞ | OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap | 1.336.693 | 0,10 |
| Anlagen insgesamt | | 1.216.695.569 | 92,00 |

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Schatzwechsel 0,19 % (31. Dezember 2022: 0,00 %) | | | | | |
| Thailändischer Baht | | | | | |
| 34.618.000 | Bank of Thailand Bill | 0,00 % | 09.05.2024 | 1.006.392 | 0,19 |
| Schatzwechsel insgesamt ** | | | | 1.006.392 | 0,19 |
| Unternehmensanleihen 28,11 % (31. Dezember 2022: 31,88 %) | | | | | |
| Kolumbianischer Peso | | | | | |
| 899.000.000 | Asian Development Bank* | 11,20 % | 31.01.2025 | 230.035 | 0,04 |
| 2.323.000.000 | Asian Development Bank* | 12,75 % | 03.03.2025 | 607.614 | 0,12 |
| 2.561.000.000 | Asian Development Bank* | 13,00 % | 07.03.2025 | 667.096 | 0,13 |
| 4.060.000.000 | Empresas Publicas de Medellin ESP* | 7,63 % | 10.09.2024 | 1.009.487 | 0,19 |
| 17.077.000.000 | Empresas Publicas de Medellin ESP* | 8,38 % | 08.11.2027 | 3.831.525 | 0,73 |
| 3.260.000.000 | International Finance Corp* | 0,00 % | 16.08.2028 | 545.482 | 0,10 |
| Kolumbianischer Peso insgesamt | | | | 6.891.239 | 1,31 |
| Euro | | | | | |
| 2.082.000 | NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance Plc* | 7,13 % | 19.07.2026 | 1.091.823 | 0,21 |
| 821.000 | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara* | 1,88 % | 05.11.2031 | 739.337 | 0,14 |
| Euro insgesamt | | | | 1.831.160 | 0,35 |
| Mexikanischer Peso | | | | | |
| 17.700.000 | Asian Infrastructure Investment Bank* | 0,00 % | 08.02.2038 | 288.058 | 0,05 |
| 46.510.400 | Comision Federal de Electricidad* | 7,35 % | 25.11.2025 | 2.558.589 | 0,49 |
| 43.963.800 | Comision Federal de Electricidad* | 8,18 % | 23.12.2027 | 2.343.103 | 0,44 |
| Mexikanischer Peso insgesamt | | | | 5.189.750 | 0,98 |
| US-Dollar | | | | | |
| 537.000 | Abu Dhabi Commercial Bank PJSC* | 4,50 % | 14.09.2027 | 528.438 | 0,10 |
| 600.000 | Abu Dhabi Commercial Bank PJSC* | 5,38 % | 18.07.2028 | 609.511 | 0,12 |
| 359.000 | Abu Dhabi Commercial Bank PJSC** | 8,00 % | 29.12.2049 | 382.064 | 0,07 |
| 1.439.000 | Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC* | 4,60 % | 02.11.2047 | 1.324.352 | 0,25 |
| 200.000 | Abu Dhabi National Energy Co PJSC* | 2,00 % | 29.04.2028 | 180.650 | 0,03 |
| 351.000 | Abu Dhabi National Energy Co PJSC* | 4,70 % | 24.04.2033 | 356.256 | 0,07 |
| 245.405 | Acu Petroleo Luxembourg Sarl** | 7,50 % | 13.01.2032 | 233.050 | 0,04 |
| 436.000 | Adani Electricity Mumbai Ltd** | 3,95 % | 12.02.2030 | 357.528 | 0,07 |
| 600.000 | Adani Green Energy UP Ltd/Prayatna Developers Pvt Ltd/Parampujya Solar Energ* | 6,25 % | 10.12.2024 | 593.638 | 0,11 |
| 362.000 | Aeropuerto Internacional de Tocumen SA** | 5,13 % | 11.08.2061 | 276.106 | 0,05 |
| 538.000 | Africa Finance Corp* | 2,88 % | 28.04.2028 | 472.095 | 0,09 |
| 200.000 | AIA Group Ltd* | 3,20 % | 16.09.2040 | 151.942 | 0,03 |
| 250.000 | AIA Group Ltd** | 3,38 % | 07.04.2030 | 230.468 | 0,04 |
| 300.000 | AIA Group Ltd** | 3,60 % | 09.04.2029 | 283.957 | 0,05 |
| 200.000 | AIA Group Ltd** | 4,95 % | 04.04.2033 | 201.530 | 0,04 |

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 28,11 % (31. Dezember 2022: 31,88 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 400.000 | Akbank TAS* | 5,13 % | 31.03.2025 | 396.101 | 0,08 |
| 400.000 | Akbank TAS** | 6,80 % | 06.02.2026 | 402.438 | 0,08 |
| 400.000 | Aldar Investment Properties Sukuk Ltd* | 4,88 % | 24.05.2033 | 390.486 | 0,07 |
| 837.741 | Alfa Desarrollo SpA** | 4,55 % | 27.09.2051 | 654.844 | 0,12 |
| 600.000 | Alfa SAB de CV** | 6,88 % | 25.03.2044 | 598.666 | 0,11 |
| 394.000 | Alibaba Group Holding Ltd* | 4,00 % | 06.12.2037 | 338.906 | 0,06 |
| 300.000 | Alsea SAB de CV** | 7,75 % | 14.12.2026 | 306.538 | 0,06 |
| 450.000 | Altice Financing SA** | 5,75 % | 15.08.2029 | 400.327 | 0,08 |
| 300.000 | America Movil SAB de CV* | 3,63 % | 22.04.2029 | 283.499 | 0,05 |
| 300.000 | America Movil SAB de CV* | 4,70 % | 21.07.2032 | 295.097 | 0,06 |
| 625.000 | Anglo American Capital Plc* | 3,88 % | 16.03.2029 | 586.809 | 0,11 |
| 400.000 | AngloGold Ashanti Holdings Plc* | 3,38 % | 01.11.2028 | 360.348 | 0,07 |
| 310.000 | Antofagasta Plc* | 5,63 % | 13.05.2032 | 311.987 | 0,06 |
| 500.000 | Axis Bank Ltd* | 4,10 % | 29.12.2049 | 456.791 | 0,09 |
| 175.000 | Azul Secured Finance LLP** | 10,88 % | 28.05.2030 | 144.827 | 0,03 |
| 200.000 | Banco Bradesco SA** | 4,38 % | 18.03.2027 | 194.509 | 0,04 |
| 635.000 | Banco Davivienda SA** | 6,65 % | 29.12.2049 | 454.819 | 0,09 |
| 650.000 | Banco de Bogota SA* | 6,25 % | 12.05.2026 | 642.287 | 0,12 |
| 400.000 | Banco de Chile** | 2,99 % | 09.12.2031 | 344.637 | 0,07 |
| 250.000 | Banco de Credito del Peru SA** | 3,13 % | 01.07.2030 | 238.016 | 0,05 |
| 775.000 | Banco de Credito e Inversiones SA** | 2,88 % | 14.10.2031 | 657.727 | 0,12 |
| 500.000 | Banco do Brasil SA** | 6,25 % | 18.04.2030 | 520.643 | 0,10 |
| 200.000 | Banco Mercantil del Norte SA* | 7,50 % | 29.12.2049 | 188.942 | 0,04 |
| 500.000 | Banco Mercantil del Norte SA* | 7,63 % | 29.12.2049 | 481.066 | 0,09 |
| 400.000 | Banco Santander Chile** | 3,18 % | 26.10.2031 | 346.810 | 0,07 |
| 400.000 | Bancolombia SA* | 4,63 % | 18.12.2029 | 371.094 | 0,07 |
| 1.000.000 | Bangkok Bank PCL** | 3,73 % | 25.09.2034 | 889.610 | 0,17 |
| 402.000 | Bangkok Bank PCL* | 4,30 % | 15.06.2027 | 394.151 | 0,07 |
| 854.000 | Bangkok Bank PCL** | 5,00 % | 29.12.2049 | 818.405 | 0,16 |
| 300.000 | Bank Hapoalim BM* | 3,26 % | 21.01.2032 | 260.787 | 0,05 |
| 500.000 | Bank Leumi Le-Israel BM** | 3,28 % | 29.01.2031 | 453.225 | 0,09 |
| 418.000 | Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT** | 3,75 % | 30.03.2026 | 399.935 | 0,08 |
| 500.000 | Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT* | 4,30 % | 29.12.2049 | 444.266 | 0,08 |
| 1.708.000 | Banque Ouest Africaine de Developpement* | 4,70 % | 22.10.2031 | 1.459.640 | 0,28 |
| 550.000 | BBVA Bancomer SA** | 5,13 % | 18.01.2033 | 498.735 | 0,09 |
| 400.000 | Bidvest Group UK Plc* | 3,63 % | 23.09.2026 | 372.000 | 0,07 |
| 800.000 | BOC Aviation Ltd* | 3,00 % | 11.09.2029 | 720.044 | 0,14 |
| 274.000 | BOC Aviation Ltd** | 3,50 % | 18.09.2027 | 260.780 | 0,05 |
| 350.000 | BOC Aviation Ltd* | 4,50 % | 23.05.2028 | 343.613 | 0,07 |
| 200.000 | Borr IHC Ltd/Borr Finance LLC** | 10,00 % | 15.11.2028 | 209.000 | 0,04 |

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 28,11 % (31. Dezember 2022: 31,88 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 375.000 | Braskem Idesa SAPI** | 6,99 % | 20.02.2032 | 212.179 | 0,04 |
| 523.500 | Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais** | 5,33 % | 15.02.2028 | 515.820 | 0,10 |
| 550.000 | BRF SA** | 4,88 % | 24.01.2030 | 484.221 | 0,09 |
| 665.000 | BSF Finance* | 5,50 % | 23.11.2027 | 675.806 | 0,13 |
| 263.000 | Canacol Energy Ltd** | 5,75 % | 24.11.2028 | 192.052 | 0,04 |
| 500.000 | CBQ Finance Ltd* | 2,00 % | 15.09.2025 | 470.790 | 0,09 |
| 400.000 | CBQ Finance Ltd* | 2,00 % | 12.05.2026 | 369.224 | 0,07 |
| 300.000 | CDBL Funding 2* | 2,00 % | 04.03.2026 | 282.143 | 0,05 |
| 300.000 | Celulosa Arauco y Constitucion SA** | 4,25 % | 30.04.2029 | 280.079 | 0,05 |
| 500.000 | Cemex SAB de CV** | 5,13 % | 29.12.2049 | 474.591 | 0,09 |
| 622.000 | Cemex SAB de CV** | 9,13 % | 29.12.2049 | 663.208 | 0,13 |
| 400.000 | Cencosud SA* | 4,38 % | 17.07.2027 | 386.186 | 0,07 |
| 645.000 | Central American Bottling Corp/CBC Bottling Holdco SL/Beliv Holdco SL** | 5,25 % | 27.04.2029 | 606.390 | 0,11 |
| 300.000 | Champion Path Holdings Ltd** | 4,85 % | 27.01.2028 | 258.472 | 0,05 |
| 300.000 | China Cinda Finance 2017 I Ltd* | 4,75 % | 08.02.2028 | 293.584 | 0,06 |
| 300.000 | China Construction Bank Corp* | 2,45 % | 24.06.2030 | 287.421 | 0,05 |
| 300.000 | China Overseas Finance Cayman VI Ltd** | 5,95 % | 08.05.2024 | 300.086 | 0,06 |
| 531.000 | Cia Cervecerias Unidas SA** | 3,35 % | 19.01.2032 | 457.650 | 0,09 |
| 400.000 | Cia de Minas Buenaventura SAA** | 5,50 % | 23.07.2026 | 382.217 | 0,07 |
| 410.000 | Cibanco SA Ibm/PLA Administradora Industrial S de RL de CV** | 4,96 % | 18.07.2029 | 391.631 | 0,07 |
| 400.000 | CK Hutchison International 23 Ltd* | 4,88 % | 21.04.2033 | 401.617 | 0,08 |
| 200.000 | CMB International Leasing Management Ltd* | 1,88 % | 12.08.2025 | 189.736 | 0,04 |
| 150.000 | Coca-Cola Femsab SAB de CV* | 1,85 % | 01.09.2032 | 119.445 | 0,02 |
| 214.000 | Colbun SA** | 3,15 % | 19.01.2032 | 185.406 | 0,04 |
| 669.000 | Comision Federal de Electricidad* | 3,35 % | 09.02.2031 | 559.481 | 0,11 |
| 664.000 | Comision Federal de Electricidad* | 4,69 % | 15.05.2029 | 625.606 | 0,12 |
| 275.000 | Comision Federal de Electricidad* | 6,26 % | 15.02.2052 | 241.595 | 0,05 |
| 800.000 | Commercial Bank PSQC* | 4,50 % | 29.12.2049 | 733.928 | 0,14 |
| 356.500 | Continuum Energy Levanter Pte Ltd** | 4,50 % | 09.02.2027 | 335.508 | 0,06 |
| 200.000 | Corp Nacional del Cobre de Chile* | 5,13 % | 02.02.2033 | 194.152 | 0,04 |
| 211.000 | Corp Nacional del Cobre de Chile* | 5,95 % | 08.01.2034 | 214.454 | 0,04 |
| 800.000 | CSN Resources SA** | 4,63 % | 10.06.2031 | 655.034 | 0,13 |
| 544.000 | CT Trust** | 5,13 % | 03.02.2032 | 476.031 | 0,09 |
| 600.000 | DIB Sukuk Ltd* | 2,95 % | 16.01.2026 | 575.417 | 0,11 |
| 489.000 | DIB Sukuk Ltd* | 4,80 % | 16.08.2028 | 485.587 | 0,09 |
| 692.000 | DIB Sukuk Ltd* | 5,49 % | 30.11.2027 | 705.935 | 0,13 |
| 497.000 | DIB Tier 1 Sukuk 3 Ltd* | 6,25 % | 29.12.2049 | 495.817 | 0,09 |
| 1.190.000 | DP World Ltd* | 6,85 % | 02.07.2037 | 1.316.445 | 0,25 |
| 451.000 | Ecopetrol SA** | 5,88 % | 28.05.2045 | 356.748 | 0,07 |
| 500.000 | Ecopetrol SA** | 6,88 % | 29.04.2030 | 496.093 | 0,09 |
| 599.000 | Ecopetrol SA* | 8,88 % | 13.01.2033 | 651.506 | 0,12 |

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 28,11 % (31. Dezember 2022: 31,88 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 200.000 | EIG Pearl Holdings Sarl* | 3,55 % | 31.08.2036 | 174.675 | 0,03 |
| 300.000 | EIG Pearl Holdings Sarl* | 4,39 % | 30.11.2046 | 241.620 | 0,05 |
| 300.000 | Emaar Sukuk Ltd** | 3,64 % | 15.09.2026 | 287.329 | 0,05 |
| 200.000 | Embraer Netherlands Finance BV** | 7,00 % | 28.07.2030 | 209.999 | 0,04 |
| 720.000 | Emirates NBD Bank PJSC* | 5,88 % | 11.10.2028 | 745.229 | 0,14 |
| 600.000 | Emirates NBD Bank PJSC* | 6,13 % | 29.12.2049 | 597.402 | 0,11 |
| 550.000 | Empresa de los Ferrocarriles del Estado* | 3,07 % | 18.08.2050 | 335.443 | 0,06 |
| 941.000 | Empresa de Transmision Electrica SA* | 5,13 % | 02.05.2049 | 683.961 | 0,13 |
| 362.000 | Empresa Nacional del Petroleo** | 3,45 % | 16.09.2031 | 305.494 | 0,06 |
| 440.000 | Empresa Nacional del Petroleo** | 3,75 % | 05.08.2026 | 418.434 | 0,08 |
| 206.000 | Empresa Nacional del Petroleo** | 4,50 % | 14.09.2047 | 155.777 | 0,03 |
| 400.000 | Endeavour Mining Plc** | 5,00 % | 14.10.2026 | 370.752 | 0,07 |
| 100.000 | Energiean Israel Finance Ltd** | 5,88 % | 30.03.2031 | 84.672 | 0,02 |
| 403.425 | Energian Israel Finance Ltd** | 4,88 % | 30.03.2026 | 372.866 | 0,07 |
| 650.000 | ENN Clean Energy International Investment Ltd* | 3,38 % | 12.05.2026 | 609.954 | 0,12 |
| 700.000 | ENN Energy Holdings Ltd** | 2,63 % | 17.09.2030 | 599.534 | 0,11 |
| 700.000 | First Abu Dhabi Bank PJSC* | 6,32 % | 04.04.2034 | 722.068 | 0,14 |
| 400.000 | First Quantum Minerals Ltd** | 6,88 % | 15.10.2027 | 340.500 | 0,06 |
| 320.000 | First Quantum Minerals Ltd** | 7,50 % | 01.04.2025 | 305.410 | 0,06 |
| 500.000 | Franshion Brilliant Ltd* | 4,25 % | 23.07.2029 | 325.734 | 0,06 |
| 550.000 | FS Luxembourg Sarl** | 10,00 % | 15.12.2025 | 564.419 | 0,11 |
| 700.000 | Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd* | 2,63 % | 31.03.2036 | 578.960 | 0,11 |
| 746.496 | Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd* | 2,94 % | 30.09.2040 | 615.579 | 0,12 |
| 433.000 | GC Treasury Center Co Ltd* | 2,98 % | 18.03.2031 | 366.446 | 0,07 |
| 800.000 | GC Treasury Center Co Ltd* | 4,40 % | 30.03.2032 | 731.188 | 0,14 |
| 324.000 | GCC SAB de CV** | 3,61 % | 20.04.2032 | 279.418 | 0,05 |
| 700.000 | GENM Capital Labuan Ltd* | 3,88 % | 19.04.2031 | 597.868 | 0,11 |
| 700.000 | Globe Telecom Inc* | 4,20 % | 29.12.2049 | 662.860 | 0,13 |
| 241.000 | Gohl Capital Ltd* | 4,25 % | 24.01.2027 | 232.128 | 0,04 |
| 408.850 | Greenko Dutch BV** | 3,85 % | 29.03.2026 | 381.631 | 0,07 |
| 450.000 | Greenko Power II Ltd* | 4,30 % | 13.12.2028 | 406.800 | 0,08 |
| 427.000 | Greensaif Pipelines Bidco Sarl* | 6,51 % | 23.02.2042 | 451.562 | 0,09 |
| 550.000 | Grupo Aval Ltd* | 4,38 % | 04.02.2030 | 467.609 | 0,09 |
| 600.000 | Grupo de Inversiones Suramericana SA* | 5,50 % | 29.04.2026 | 589.520 | 0,11 |
| 200.000 | Grupo Televisa SAB* | 6,63 % | 15.01.2040 | 209.634 | 0,04 |
| 273.316 | Guara Norte Sarl** | 5,20 % | 15.06.2034 | 249.292 | 0,05 |
| 300.000 | Gulf International Bank BSC* | 2,38 % | 23.09.2025 | 281.504 | 0,05 |
| 500.000 | Hanwha Life Insurance Co Ltd** | 3,38 % | 04.02.2032 | 461.241 | 0,09 |
| 600.000 | HDFC Bank Ltd** | 3,70 % | 29.12.2049 | 547.529 | 0,10 |
| 200.000 | Huarong Finance 2017 Co Ltd* | 4,25 % | 07.11.2027 | 182.804 | 0,03 |
| 500.000 | Huarong Finance II Co Ltd* | 5,50 % | 16.01.2025 | 495.625 | 0,09 |

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 28,11 % (31. Dezember 2022: 31,88 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 200.000 | Hunt Oil Co of Peru LLC Sucursal Del Peru** | 8,55 % | 18.09.2033 | 218.883 | 0,04 |
| 557.000 | Hyundai Capital America** | 2,75 % | 27.09.2026 | 520.371 | 0,10 |
| 200.000 | Hyundai Capital America** | 5,68 % | 26.06.2028 | 203.999 | 0,04 |
| 700.000 | IHS Netherlands Holdco BV** | 8,00 % | 18.09.2027 | 625.772 | 0,12 |
| 400.000 | Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT** | 3,54 % | 27.04.2032 | 346.459 | 0,07 |
| 400.000 | InRetail Consumer** | 3,25 % | 22.03.2028 | 359.294 | 0,07 |
| 333.000 | Inversiones CMPC SA** | 6,13 % | 23.06.2033 | 344.997 | 0,07 |
| 200.000 | Itau Unibanco Holding SA* | 3,88 % | 15.04.2031 | 191.697 | 0,04 |
| 161.000 | JSW Hydro Energy Ltd* | 4,13 % | 18.05.2031 | 140.454 | 0,03 |
| 300.000 | JSW Steel Ltd* | 5,05 % | 05.04.2032 | 259.062 | 0,05 |
| 200.000 | Kallpa Generacion SA* | 4,13 % | 16.08.2027 | 191.322 | 0,04 |
| 400.000 | Kasikornbank PCL* | 3,34 % | 02.10.2031 | 368.444 | 0,07 |
| 408.000 | Kasikornbank PCL* | 5,46 % | 07.03.2028 | 416.184 | 0,08 |
| 200.000 | KazMunayGas National Co JSC* | 3,50 % | 14.04.2033 | 166.715 | 0,03 |
| 350.000 | KazMunayGas National Co JSC* | 5,38 % | 24.04.2030 | 347.840 | 0,07 |
| 1.885.000 | KazMunayGas National Co JSC* | 5,75 % | 19.04.2047 | 1.657.051 | 0,31 |
| 200.000 | Klabn Austria GmbH** | 3,20 % | 12.01.2031 | 167.681 | 0,03 |
| 300.000 | Klabn Austria GmbH* | 7,00 % | 03.04.2049 | 303.502 | 0,06 |
| 200.000 | KOC Holding AS* | 6,50 % | 11.03.2025 | 199.565 | 0,04 |
| 700.000 | Kookmin Bank** | 2,50 % | 04.11.2030 | 583.398 | 0,11 |
| 600.000 | Kosmos Energy Ltd* | 7,13 % | 04.04.2026 | 572.584 | 0,11 |
| 300.000 | Kyobo Life Insurance Co Ltd* | 5,90 % | 15.06.2052 | 296.109 | 0,06 |
| 118.000 | Latam Airlines Group SA** | 13,38 % | 15.10.2029 | 135.246 | 0,03 |
| 500.000 | Lenovo Group Ltd* | 3,42 % | 02.11.2030 | 441.861 | 0,08 |
| 356.985 | Leviathan Bond Ltd* | 6,50 % | 30.06.2027 | 336.702 | 0,06 |
| 275.000 | Longfor Group Holdings Ltd** | 3,95 % | 16.09.2029 | 127.471 | 0,02 |
| 700.000 | MAF Global Securities Ltd* | 7,88 % | 29.12.2049 | 716.058 | 0,14 |
| 670.000 | MARB BondCo Plc* | 3,95 % | 29.01.2031 | 544.828 | 0,10 |
| 541.101 | MC Brazil Downstream Trading Sarl** | 7,25 % | 30.06.2031 | 424.732 | 0,08 |
| 364.000 | MDGH GMTN RSC Ltd* | 4,38 % | 22.11.2033 | 355.023 | 0,07 |
| 200.000 | MDGH GMTN RSC Ltd* | 5,88 % | 01.05.2034 | 218.658 | 0,04 |
| 750.000 | Medco Bell Pte Ltd** | 6,38 % | 30.01.2027 | 714.609 | 0,14 |
| 400.000 | MEGlobal Canada ULC* | 5,00 % | 18.05.2025 | 395.980 | 0,07 |
| 300.000 | MEGlobal Canada ULC* | 5,88 % | 18.05.2030 | 309.268 | 0,06 |
| 200.000 | Meituan* | 3,05 % | 28.10.2030 | 168.956 | 0,03 |
| 600.000 | Melco Resorts Finance Ltd** | 5,63 % | 17.07.2027 | 562.870 | 0,11 |
| 500.000 | Melco Resorts Finance Ltd* | 5,75 % | 21.07.2028 | 463.512 | 0,09 |
| 474.000 | Mersin Uluslararası Liman İşletmeciliği AS* | 8,25 % | 15.11.2028 | 495.553 | 0,09 |
| 885.000 | Mexico City Airport Trust* | 5,50 % | 31.07.2047 | 764.936 | 0,15 |
| 250.000 | Millicom International Cellular SA** | 4,50 % | 27.04.2031 | 207.935 | 0,04 |
| 540.000 | Millicom International Cellular SA* | 5,13 % | 15.01.2028 | 503.544 | 0,10 |

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 28,11 % (31. Dezember 2022: 31,88 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 180.000 | Millicom International Cellular SA* | 6,25 % | 25.03.2029 | 170.778 | 0,03 |
| 900.000 | Minera Mexico SA de CV** | 4,50 % | 26.01.2050 | 726.674 | 0,14 |
| 600.000 | Minerva Luxembourg SA** | 8,88 % | 13.09.2033 | 635.426 | 0,12 |
| 450.000 | Minsur SA** | 4,50 % | 28.10.2031 | 398.219 | 0,08 |
| 240.000 | MSU Energy SA/UGEN SA/UENSA SA** | 6,88 % | 01.02.2025 | 183.240 | 0,03 |
| 350.000 | MTR Corp Ltd** | 1,63 % | 19.08.2030 | 292.496 | 0,06 |
| 353.992 | MV24 Capital BV* | 6,75 % | 01.06.2034 | 331.625 | 0,06 |
| 345.077 | Nakilat Inc** | 6,07 % | 31.12.2033 | 356.594 | 0,07 |
| 300.000 | Nanyang Commercial Bank Ltd* | 3,80 % | 20.11.2029 | 293.267 | 0,06 |
| 700.000 | NBK Tier 1 Financing 2 Ltd* | 4,50 % | 29.12.2049 | 673.159 | 0,13 |
| 400.000 | Nemak SAB de CV** | 3,63 % | 28.06.2031 | 332.589 | 0,06 |
| 400.000 | Nexa Resources SA** | 5,38 % | 04.05.2027 | 390.799 | 0,07 |
| 469.000 | NWD MTN Ltd** | 4,13 % | 18.07.2029 | 357.866 | 0,07 |
| 320.000 | Oil & Gas Holding Co BSCC** | 7,50 % | 25.10.2027 | 338.666 | 0,06 |
| 470.000 | Oil & Gas Holding Co BSCC* | 8,38 % | 07.11.2028 | 517.188 | 0,10 |
| 545.000 | Ooredoo International Finance Ltd* | 2,63 % | 08.04.2031 | 476.165 | 0,09 |
| 600.000 | Orbia Advance Corp SAB de CV** | 6,75 % | 19.09.2042 | 601.183 | 0,11 |
| 300.000 | Oryx Funding Ltd** | 5,80 % | 03.02.2031 | 301.575 | 0,06 |
| 800.000 | Oversea-Chinese Banking Corp Ltd** | 1,83 % | 10.09.2030 | 752.834 | 0,14 |
| 394.000 | Oversea-Chinese Banking Corp Ltd* | 4,60 % | 15.06.2032 | 389.398 | 0,07 |
| 400.000 | Oztel Holdings SPC Ltd* | 6,63 % | 24.04.2028 | 419.150 | 0,08 |
| 600.000 | Periama Holdings LLC* | 5,95 % | 19.04.2026 | 592.643 | 0,11 |
| 339.000 | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara* | 4,38 % | 05.02.2050 | 281.017 | 0,05 |
| 510.000 | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara* | 5,25 % | 15.05.2047 | 478.918 | 0,09 |
| 1.230.000 | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara* | 6,15 % | 21.05.2048 | 1.263.216 | 0,24 |
| 300.000 | Petrobras Global Finance BV* | 5,50 % | 10.06.2051 | 253.190 | 0,05 |
| 429.000 | Petrobras Global Finance BV* | 6,50 % | 03.07.2033 | 435.968 | 0,08 |
| 13.366.824 | Petroleos de Venezuela SA* | 6,00 % | 16.05.2024 | 1.536.889 | 0,29 |
| 12.004.188 | Petroleos de Venezuela SA** | 6,00 % | 15.11.2026 | 1.395.487 | 0,26 |
| 723.000 | Petroleos del Peru SA* | 4,75 % | 19.06.2032 | 519.554 | 0,10 |
| 1.870.000 | Petroleos del Peru SA* | 5,63 % | 19.06.2047 | 1.153.743 | 0,22 |
| 474.000 | Petroleos Mexicanos** | 5,95 % | 28.01.2031 | 379.079 | 0,07 |
| 2.724.000 | Petroleos Mexicanos** | 7,69 % | 23.01.2050 | 1.940.671 | 0,38 |
| 300.000 | Petrorio Luxembourg Trading Sarl** | 6,13 % | 09.06.2026 | 294.806 | 0,06 |
| 300.000 | Power Finance Corp Ltd* | 3,95 % | 23.04.2030 | 277.774 | 0,05 |
| 600.000 | Prosus NV* | 3,83 % | 08.02.2051 | 377.398 | 0,07 |
| 550.000 | Prudential Funding Asia Plc* | 2,95 % | 03.11.2033 | 484.382 | 0,09 |
| 825.000 | QNB Finance Ltd* | 2,63 % | 12.05.2025 | 793.483 | 0,15 |
| 300.000 | REC Ltd* | 2,25 % | 01.09.2026 | 277.371 | 0,05 |
| 400.000 | Rede D'or Finance Sarl** | 4,50 % | 22.01.2030 | 362.904 | 0,07 |
| 475.000 | Reliance Industries Ltd* | 2,88 % | 12.01.2032 | 407.303 | 0,08 |

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 28,11 % (31. Dezember 2022: 31,88 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 359.000 | Reliance Industries Ltd* | 3,63 % | 12.01.2052 | 263.821 | 0,05 |
| 500.000 | ReNew Wind Energy AP2/ReNew Power Pvt Ltd other 9 Subsidiaries** | 4,50 % | 14.07.2028 | 444.804 | 0,08 |
| 580.000 | SA Global Sukuk Ltd* | 2,69 % | 17.06.2031 | 514.640 | 0,10 |
| 300.000 | SABIC Capital I BV* | 2,15 % | 14.09.2030 | 256.904 | 0,05 |
| 295.000 | Sagikor Financial Co Ltd** | 5,30 % | 13.05.2028 | 283.513 | 0,05 |
| 430.000 | Samarco Mineracao SA** | 9,50 % | 30.06.2031 | 361.630 | 0,07 |
| 360.000 | Sands China Ltd** | 4,30 % | 08.01.2026 | 345.954 | 0,07 |
| 497.000 | Sands China Ltd* | 5,38 % | 08.08.2025 | 490.439 | 0,09 |
| 1.000.000 | Sands China Ltd** | 5,65 % | 08.08.2028 | 992.273 | 0,19 |
| 800.000 | Sasol Financing USA LLC* | 6,50 % | 27.09.2028 | 762.986 | 0,14 |
| 393.000 | Sasol Financing USA LLC* | 8,75 % | 03.05.2029 | 401.380 | 0,08 |
| 1.485.000 | Saudi Arabian Oil Co* | 4,25 % | 16.04.2039 | 1.331.579 | 0,25 |
| 1.095.000 | Saudi Arabian Oil Co* | 4,38 % | 16.04.2049 | 944.492 | 0,18 |
| 200.000 | Saudi Electricity Global Sukuk Co 4* | 4,72 % | 27.09.2028 | 201.228 | 0,04 |
| 200.000 | Saudi Electricity Sukuk Programme Co* | 5,68 % | 11.04.2053 | 205.745 | 0,04 |
| 700.000 | SEPLAT Energy Plc* | 7,75 % | 01.04.2026 | 645.400 | 0,12 |
| 513.000 | SF Holding Investment 2021 Ltd* | 3,13 % | 17.11.2031 | 445.751 | 0,08 |
| 353.000 | Shelf Drilling Holdings Ltd** | 9,63 % | 15.04.2029 | 345.696 | 0,07 |
| 1.298.000 | Shinhan Bank Co Ltd* | 4,38 % | 13.04.2032 | 1.203.397 | 0,23 |
| 300.000 | SierraCol Energy Andina LLC** | 6,00 % | 15.06.2028 | 252.732 | 0,05 |
| 300.000 | Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd** | 4,75 % | 05.08.2029 | 20.250 | 0,00 |
| 400.000 | Sitios Latinoamerica SAB de CV** | 5,38 % | 04.04.2032 | 372.219 | 0,07 |
| 293.000 | SK Hynix Inc* | 6,38 % | 17.01.2028 | 302.841 | 0,06 |
| 500.000 | SK Hynix Inc* | 6,50 % | 17.01.2033 | 528.276 | 0,10 |
| 400.000 | SNB Sukuk Ltd* | 2,34 % | 19.01.2027 | 370.218 | 0,07 |
| 1.831.000 | Southern Gas Corridor CJSC* | 6,88 % | 24.03.2026 | 1.862.676 | 0,35 |
| 200.000 | Standard Chartered Plc* | 1,46 % | 14.01.2027 | 183.334 | 0,03 |
| 579.000 | Standard Chartered Plc* | 6,30 % | 06.07.2034 | 608.476 | 0,12 |
| 2.086.000 | State Oil Co of the Azerbaijan Republic* | 6,95 % | 18.03.2030 | 2.199.426 | 0,41 |
| 300.000 | Studio City Finance Ltd** | 6,00 % | 15.07.2025 | 293.965 | 0,06 |
| 300.000 | Studio City Finance Ltd* | 6,50 % | 15.01.2028 | 278.648 | 0,05 |
| 400.000 | Sun Hung Kai Properties Capital Market Ltd** | 3,75 % | 25.02.2029 | 376.438 | 0,07 |
| 604.000 | Suzano Austria GmbH** | 7,00 % | 16.03.2047 | 639.431 | 0,12 |
| 400.000 | Telecom Argentina SA** | 8,00 % | 18.07.2026 | 379.911 | 0,07 |
| 600.000 | Telecomunicaciones Digitales SA** | 4,50 % | 30.01.2030 | 517.740 | 0,10 |
| 700.000 | Telefonica Celular del Paraguay SA** | 5,88 % | 15.04.2027 | 682.080 | 0,13 |
| 400.000 | Tencent Holdings Ltd* | 3,24 % | 03.06.2050 | 267.083 | 0,05 |
| 200.000 | Tencent Holdings Ltd** | 3,68 % | 22.04.2041 | 157.441 | 0,03 |
| 600.000 | Tengizchevroil Finance Co International Ltd** | 3,25 % | 15.08.2030 | 495.852 | 0,09 |
| 300.000 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV* | 3,15 % | 01.10.2026 | 277.990 | 0,05 |
| 800.000 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV* | 4,10 % | 01.10.2046 | 542.634 | 0,10 |

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|---------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 28,11 % (31. Dezember 2022: 31,88 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 400.000 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV** | 8,13 % | 15.09.2031 | 436.732 | 0,08 |
| 834.000 | Thaioil Treasury Center Co Ltd* | 3,75 % | 18.06.2050 | 588.415 | 0,11 |
| 750.000 | TNB Global Ventures Capital Bhd* | 4,85 % | 01.11.2028 | 746.936 | 0,14 |
| 300.000 | Total Play Telecomunicaciones SA de CV* | 6,38 % | 20.09.2028 | 122.259 | 0,02 |
| 200.000 | Transportadora de Gas del Sur SA* | 6,75 % | 02.05.2025 | 191.503 | 0,04 |
| 200.000 | Trust Fibra Uno** | 5,25 % | 15.12.2024 | 197.999 | 0,04 |
| 200.000 | Trust Fibra Uno** | 6,95 % | 30.01.2044 | 172.760 | 0,03 |
| 200.000 | TSMC Arizona Corp* | 2,50 % | 25.10.2031 | 172.286 | 0,03 |
| 600.000 | TSMC Arizona Corp* | 4,25 % | 22.04.2032 | 591.637 | 0,11 |
| 400.000 | Turk Telekomunikasyon AS* | 4,88 % | 19.06.2024 | 393.500 | 0,07 |
| 300.000 | Turk Telekomunikasyon AS* | 6,88 % | 28.02.2025 | 297.450 | 0,06 |
| 400.000 | Turkcell Iletisim Hizmetleri AS* | 5,80 % | 11.04.2028 | 380.384 | 0,07 |
| 300.000 | Turkiye Petrol Rafinerileri AS* | 4,50 % | 18.10.2024 | 295.467 | 0,06 |
| 400.000 | Turkiye Sise ve Cam Fabrikalari AS* | 6,95 % | 14.03.2026 | 399.248 | 0,08 |
| 600.000 | Turkiye Vakiflar Bankasi TAO* | 5,50 % | 01.10.2026 | 575.955 | 0,11 |
| 773.000 | Turkiye Vakiflar Bankasi TAO* | 9,00 % | 12.10.2028 | 812.531 | 0,15 |
| 955.000 | United Overseas Bank Ltd* | 2,00 % | 14.10.2031 | 870.495 | 0,17 |
| 428.000 | United Overseas Bank Ltd* | 3,86 % | 07.10.2032 | 409.498 | 0,08 |
| 228.000 | Vale Overseas Ltd* | 3,75 % | 08.07.2030 | 210.081 | 0,04 |
| 455.000 | Vale Overseas Ltd* | 6,13 % | 12.06.2033 | 472.822 | 0,09 |
| 350.000 | Vale Overseas Ltd* | 6,88 % | 21.11.2036 | 382.263 | 0,07 |
| 750.000 | Vedanta Resources Finance II Plc* | 8,95 % | 11.03.2025 | 558.405 | 0,11 |
| 250.000 | Vedanta Resources Finance II Plc* | 13,88 % | 21.01.2024 | 220.945 | 0,04 |
| 100.000 | Vnesheconombank Via VEB Finance Plc* | 6,80 % | 22.11.2025 | 6.909 | 0,00 |
| 837.000 | VTR Finance NV** | 6,38 % | 15.07.2028 | 219.136 | 0,04 |
| 600.000 | WE Soda Investments Holding Plc** | 9,50 % | 06.10.2028 | 620.880 | 0,12 |
| 200.000 | Woori Bank* | 4,88 % | 26.01.2028 | 200.938 | 0,04 |
| 1.200.000 | Wynn Macau Ltd* | 5,63 % | 26.08.2028 | 1.112.489 | 0,21 |
| 350.000 | Yapi ve Kredi Bankasi AS* | 5,85 % | 21.06.2024 | 349.671 | 0,07 |
| 660.000 | Yapi ve Kredi Bankasi AS** | 9,25 % | 16.10.2028 | 700.791 | 0,13 |
| 400.000 | YPF SA* | 6,95 % | 21.07.2027 | 358.309 | 0,07 |
| 575.000 | YPF SA** | 7,00 % | 15.12.2047 | 434.962 | 0,08 |
| 500.000 | YPF SA* | 8,50 % | 28.07.2025 | 483.191 | 0,09 |
| | US-Dollar insgesamt | | | 134.165.703 | 25,47 |
| | Unternehmensanleihen insgesamt | | | 148.077.852 | 28,11 |
| Staatsanleihen 62,75 % (31. Dezember 2022: 61,28 %) | | | | | |
| Chilenischer Peso | | | | | |
| 1.122.328.020 | Bonos de la Tesoreria de la Republica* | 1,90 % | 01.09.2030 | 1.263.267 | 0,24 |
| 320.000.000 | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 4,70 % | 01.09.2030 | 359.049 | 0,07 |
| 420.000.000 | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 5,00 % | 01.03.2035 | 480.910 | 0,09 |

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 62,75 % (31. Dezember 2022: 61,28 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Chilenischer Peso (Fortsetzung) | | | | | |
| 5.000.000 | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos [*] | 5,10 % | 15.07.2050 | 5.726 | 0,00 |
| 865.000.000 | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos [*] | 6,00 % | 01.04.2033 | 1.057.616 | 0,20 |
| 335.000.000 | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos [*] | 7,00 % | 01.05.2034 | 439.875 | 0,09 |
| Chilenischer Peso insgesamt | | | | 3.606.443 | 0,69 |
| Chinesischer Yuan Renminbi | | | | | |
| 16.000.000 | China Government Bond ^{**} | 1,99 % | 09.04.2025 | 2.250.543 | 0,43 |
| 7.000.000 | China Government Bond ^{**} | 2,40 % | 15.07.2028 | 986.958 | 0,19 |
| 3.000.000 | China Government Bond ^{**} | 2,52 % | 25.08.2033 | 421.136 | 0,08 |
| 5.400.000 | China Government Bond ^{**} | 2,60 % | 15.09.2030 | 764.865 | 0,14 |
| 7.000.000 | China Government Bond ^{**} | 2,62 % | 25.09.2029 | 993.500 | 0,19 |
| 6.800.000 | China Government Bond ^{**} | 2,62 % | 25.06.2030 | 963.937 | 0,18 |
| 2.000.000 | China Government Bond ^{**} | 2,64 % | 15.01.2028 | 284.943 | 0,05 |
| 8.800.000 | China Government Bond ^{**} | 2,67 % | 25.05.2033 | 1.249.198 | 0,24 |
| 8.600.000 | China Government Bond ^{**} | 2,75 % | 15.06.2029 | 1.229.376 | 0,23 |
| 3.000.000 | China Government Bond ^{**} | 2,80 % | 24.03.2029 | 429.987 | 0,08 |
| 7.000.000 | China Government Bond ^{**} | 2,80 % | 25.03.2030 | 1.002.126 | 0,19 |
| 3.900.000 | China Government Bond ^{**} | 2,80 % | 15.11.2032 | 558.944 | 0,11 |
| 400.000 | China Government Bond ^{**} | 2,88 % | 25.02.2033 | 57.794 | 0,01 |
| 8.000.000 | China Government Bond ^{**} | 2,91 % | 14.10.2028 | 1.154.844 | 0,22 |
| 1.000.000 | China Government Bond ^{**} | 3,00 % | 15.10.2053 | 146.111 | 0,03 |
| 3.000.000 | China Government Bond ^{**} | 3,01 % | 13.05.2028 | 434.302 | 0,08 |
| 12.800.000 | China Government Bond ^{**} | 3,02 % | 22.10.2025 | 1.832.637 | 0,35 |
| 3.000.000 | China Government Bond ^{**} | 3,02 % | 27.05.2031 | 437.019 | 0,08 |
| 6.000.000 | China Government Bond ^{**} | 3,13 % | 21.11.2029 | 877.913 | 0,17 |
| 3.050.000 | China Government Bond ^{**} | 3,19 % | 15.04.2053 | 457.783 | 0,09 |
| 5.000.000 | China Government Bond ^{**} | 3,27 % | 19.11.2030 | 741.184 | 0,14 |
| 3.650.000 | China Government Bond ^{**} | 3,72 % | 12.04.2051 | 595.797 | 0,11 |
| 6.400.000 | China Government Bond ^{**} | 3,81 % | 14.09.2050 | 1.057.817 | 0,20 |
| Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt | | | | 18.928.714 | 3,59 |
| Kolumbianischer Peso | | | | | |
| 8.832.900.000 | Colombian TES [*] | 5,75 % | 03.11.2027 | 2.021.261 | 0,38 |
| 41.141.900.000 | Colombian TES [*] | 6,00 % | 28.04.2028 | 9.375.340 | 1,78 |
| 4.690.100.000 | Colombian TES [*] | 7,00 % | 30.06.2032 | 1.015.321 | 0,19 |
| 3.417.700.000 | Colombian TES [*] | 7,25 % | 18.10.2034 | 726.857 | 0,14 |
| 6.013.100.000 | Colombian TES [*] | 7,75 % | 18.09.2030 | 1.415.733 | 0,27 |
| 5.092.800.000 | Colombian TES [*] | 9,25 % | 28.05.2042 | 1.193.700 | 0,23 |
| 12.958.400.000 | Colombian TES [*] | 13,25 % | 09.02.2033 | 3.972.907 | 0,75 |
| 2.356.900.000 | Colombian TES Series G [*] | 7,00 % | 26.03.2031 | 525.190 | 0,10 |
| 171.000.000 | Financiera de Desarrollo Territorial SA Findeter [*] | 7,88 % | 12.08.2024 | 42.569 | 0,01 |
| Kolumbianischer Peso insgesamt | | | | 20.288.878 | 3,85 |

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 62,75 % (31. Dezember 2022: 61,28 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Tschechische Krone | | | | | |
| 56.660.000 | Czech Republic Government Bond* | 0,05 % | 29.11.2029 | 2.051.093 | 0,39 |
| 43.790.000 | Czech Republic Government Bond* | 0,25 % | 10.02.2027 | 1.752.493 | 0,33 |
| 75.850.000 | Czech Republic Government Bond* | 1,00 % | 26.06.2026 | 3.150.468 | 0,60 |
| 71.790.000 | Czech Republic Government Bond* | 1,20 % | 13.03.2031 | 2.711.379 | 0,51 |
| 7.530.000 | Czech Republic Government Bond* | 1,50 % | 24.04.2040 | 242.578 | 0,05 |
| 6.760.000 | Czech Republic Government Bond* | 1,95 % | 30.07.2037 | 243.879 | 0,05 |
| 30.900.000 | Czech Republic Government Bond* | 2,00 % | 13.10.2033 | 1.190.363 | 0,23 |
| 23.780.000 | Czech Republic Government Bond* | 2,50 % | 25.08.2028 | 1.010.191 | 0,19 |
| 43.050.000 | Czech Republic Government Bond* | 2,75 % | 23.07.2029 | 1.831.151 | 0,35 |
| 16.820.000 | Czech Republic Government Bond* | 4,20 % | 04.12.2036 | 784.158 | 0,15 |
| 16.750.000 | Czech Republic Government Bond* | 6,20 % | 16.06.2031 | 874.088 | 0,16 |
| Tschechische Krone insgesamt | | | | 15.841.841 | 3,01 |
| Peso Dominikanische Republik | | | | | |
| 36.550.000 | Dominican Republic International Bond* | 9,75 % | 05.06.2026 | 630.011 | 0,12 |
| 33.450.000 | Dominican Republic International Bond* | 11,25 % | 15.09.2035 | 623.041 | 0,12 |
| 9.650.000 | Dominican Republic International Bond* | 13,63 % | 03.02.2033 | 202.677 | 0,04 |
| Peso Dominikanische Republik insgesamt | | | | 1.455.729 | 0,28 |
| Euro | | | | | |
| 345.561 | Argentine Republic Government International Bond* | 0,13 % | 09.07.2030 | 138.241 | 0,03 |
| 456.000 | Bank Gospodarstwa Krajowego* | 5,13 % | 22.02.2033 | 548.878 | 0,10 |
| 166.000 | Benin Government International Bond* | 4,88 % | 19.01.2032 | 150.563 | 0,03 |
| 413.000 | Benin Government International Bond* | 4,95 % | 22.01.2035 | 360.699 | 0,07 |
| 136.000 | Benin Government International Bond* | 6,88 % | 19.01.2052 | 118.699 | 0,02 |
| 273.841 | Chile Government International Bond* | 4,13 % | 05.07.2034 | 309.653 | 0,06 |
| 1.740.000 | Egypt Government International Bond* | 6,38 % | 11.04.2031 | 1.238.957 | 0,23 |
| 300.000 | Indonesia Government International Bond* | 1,10 % | 12.03.2033 | 263.029 | 0,05 |
| 468.000 | Indonesia Government International Bond* | 1,30 % | 23.03.2034 | 407.274 | 0,08 |
| 922.000 | Indonesia Government International Bond* | 1,40 % | 30.10.2031 | 866.045 | 0,16 |
| 240.000 | Indonesia Government International Bond* | 3,75 % | 14.06.2028 | 267.472 | 0,05 |
| 2.093.000 | Ivory Coast Government International Bond* | 6,63 % | 22.03.2048 | 1.849.626 | 0,35 |
| 1.920.000 | Ivory Coast Government International Bond* | 6,88 % | 17.10.2040 | 1.780.943 | 0,34 |
| 950.000 | Kazakhstan Government International Bond* | 1,50 % | 30.09.2034 | 841.303 | 0,16 |
| 181.000 | Magyar Export-Import Bank Zrt* | 6,00 % | 16.05.2029 | 212.656 | 0,04 |
| 1.145.000 | Peruvian Government International Bond* | 1,25 % | 11.03.2033 | 995.917 | 0,19 |
| 835.000 | Peruvian Government International Bond* | 1,95 % | 17.11.2036 | 697.787 | 0,13 |
| 400.000 | Philippine Government International Bond* | 1,75 % | 28.04.2041 | 309.993 | 0,06 |
| 987.877 | Provincia de Buenos Aires* | 4,50 % | 01.09.2037 | 378.868 | 0,07 |
| 615.000 | Republic of Cameroon International Bond* | 5,95 % | 07.07.2032 | 503.338 | 0,10 |

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 62,75 % (31. Dezember 2022: 61,28 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Euro (Fortsetzung) | | | | | |
| 204.000 | Republic of Poland Government International Bond* | 4,25 % | 14.02.2043 | 238.237 | 0,04 |
| 1.179.000 | Romanian Government International Bond* | 2,00 % | 28.01.2032 | 1.011.343 | 0,19 |
| 186.000 | Romanian Government International Bond* | 2,63 % | 02.12.2040 | 138.644 | 0,03 |
| 322.000 | Romanian Government International Bond* | 2,88 % | 13.04.2042 | 241.461 | 0,05 |
| 2.266.000 | Romanian Government International Bond* | 3,38 % | 28.01.2050 | 1.714.649 | 0,33 |
| 1.314.000 | Romanian Government International Bond* | 3,75 % | 07.02.2034 | 1.255.141 | 0,24 |
| 144.000 | Romanian Government International Bond* | 6,38 % | 18.09.2033 | 168.537 | 0,03 |
| 1.207.000 | Serbia International Bond* | 1,50 % | 26.06.2029 | 1.129.258 | 0,21 |
| 566.000 | Serbia International Bond* | 1,65 % | 03.03.2033 | 463.773 | 0,09 |
| 1.072.000 | Serbia International Bond* | 2,05 % | 23.09.2036 | 827.029 | 0,16 |
| 412.000 | Serbia International Bond* | 3,13 % | 15.05.2027 | 436.466 | 0,08 |
| 488.000 | Tunisian Republic* | 5,63 % | 17.02.2024 | 521.878 | 0,10 |
| 417.000 | Tunisian Republic* | 6,38 % | 15.07.2026 | 322.878 | 0,06 |
| Euro insgesamt | | | | 20.709.235 | 3,93 |
| Ghanaischer Cedi | | | | | |
| 1.545.051 | Republic of Ghana Government Bonds* | 8,35 % | 16.02.2027 | 72.130 | 0,01 |
| 1.546.190 | Republic of Ghana Government Bonds* | 8,50 % | 15.02.2028 | 62.435 | 0,01 |
| 1.444.175 | Republic of Ghana Government Bonds* | 8,65 % | 13.02.2029 | 51.685 | 0,01 |
| 1.445.239 | Republic of Ghana Government Bonds* | 8,80 % | 12.02.2030 | 46.999 | 0,01 |
| 1.446.303 | Republic of Ghana Government Bonds* | 8,95 % | 11.02.2031 | 43.518 | 0,01 |
| 1.447.366 | Republic of Ghana Government Bonds* | 9,10 % | 10.02.2032 | 41.178 | 0,01 |
| 1.448.430 | Republic of Ghana Government Bonds* | 9,25 % | 08.02.2033 | 39.521 | 0,01 |
| Ghanaischer Cedi insgesamt | | | | 357.466 | 0,07 |
| Ungarischer Forint | | | | | |
| 167.210.000 | Hungary Government Bond* | 3,00 % | 27.10.2027 | 440.569 | 0,08 |
| 492.660.000 | Hungary Government Bond* | 3,25 % | 22.10.2031 | 1.210.814 | 0,23 |
| 297.370.000 | Hungary Government Bond* | 4,50 % | 23.03.2028 | 819.397 | 0,16 |
| 1.037.820.000 | Hungary Government Bond* | 4,75 % | 24.11.2032 | 2.767.321 | 0,52 |
| 364.860.000 | Hungary Government Bond* | 5,50 % | 24.06.2025 | 1.042.861 | 0,20 |
| 413.150.000 | Hungary Government Bond* | 9,50 % | 21.10.2026 | 1.294.328 | 0,25 |
| Ungarischer Forint insgesamt | | | | 7.575.290 | 1,44 |
| Indonesische Rupiah | | | | | |
| 8.000.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 6,25 % | 15.06.2036 | 505.326 | 0,10 |
| 54.982.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 6,38 % | 15.08.2028 | 3.567.008 | 0,68 |
| 2.100.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 6,38 % | 15.04.2032 | 134.530 | 0,03 |
| 1.800.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 6,38 % | 15.07.2037 | 115.467 | 0,02 |
| 37.883.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 6,63 % | 15.05.2033 | 2.469.148 | 0,47 |
| 38.000.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 6,63 % | 15.02.2034 | 2.470.116 | 0,47 |

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 62,75 % (31. Dezember 2022: 61,28 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Indonesische Rupie (Fortsetzung) | | | | | |
| 44.347.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 6,88 % | 15.04.2029 | 2.926.634 | 0,55 |
| 12.300.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 7,00 % | 15.05.2027 | 812.541 | 0,15 |
| 54.048.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 7,00 % | 15.02.2033 | 3.640.929 | 0,69 |
| 36.979.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 7,13 % | 15.06.2038 | 2.517.140 | 0,48 |
| 9.750.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 7,13 % | 15.06.2042 | 659.057 | 0,12 |
| 20.998.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 7,13 % | 15.06.2043 | 1.418.131 | 0,27 |
| 16.000.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 7,50 % | 15.08.2032 | 1.100.924 | 0,21 |
| 420.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 7,50 % | 15.06.2035 | 28.906 | 0,01 |
| 13.390.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 7,50 % | 15.04.2040 | 928.948 | 0,18 |
| 3.824.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 8,25 % | 15.05.2029 | 267.837 | 0,05 |
| 23.241.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 8,25 % | 15.05.2036 | 1.697.288 | 0,32 |
| 38.000.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 8,38 % | 15.09.2026 | 2.589.274 | 0,49 |
| 917.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 8,38 % | 15.03.2034 | 66.612 | 0,01 |
| 17.761.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 8,75 % | 15.05.2031 | 1.291.130 | 0,24 |
| Indonesische Rupiah insgesamt | | | | 29.206.946 | 5,54 |
| Malaysischer Ringgit | | | | | |
| 5.700.000 | Malaysia Government Bond** | 2,63 % | 15.04.2031 | 1.146.168 | 0,22 |
| 1.750.000 | Malaysia Government Bond** | 3,58 % | 15.07.2032 | 373.784 | 0,07 |
| 7.600.000 | Malaysia Government Bond** | 3,73 % | 15.06.2028 | 1.659.177 | 0,31 |
| 3.600.000 | Malaysia Government Bond** | 3,76 % | 22.05.2040 | 749.897 | 0,14 |
| 4.780.000 | Malaysia Government Bond** | 3,83 % | 05.07.2034 | 1.033.923 | 0,20 |
| 3.300.000 | Malaysia Government Bond** | 3,90 % | 30.11.2026 | 726.009 | 0,14 |
| 10.500.000 | Malaysia Government Bond** | 3,90 % | 16.11.2027 | 2.307.943 | 0,44 |
| 1.800.000 | Malaysia Government Bond** | 3,91 % | 15.07.2026 | 395.837 | 0,08 |
| 6.565.000 | Malaysia Government Bond** | 4,07 % | 15.06.2050 | 1.403.184 | 0,27 |
| 2.410.000 | Malaysia Government Bond** | 4,25 % | 31.05.2035 | 537.737 | 0,10 |
| 2.300.000 | Malaysia Government Bond** | 4,50 % | 30.04.2029 | 520.568 | 0,10 |
| 6.800.000 | Malaysia Government Bond** | 4,50 % | 15.04.2030 | 1.543.320 | 0,29 |
| 7.448.000 | Malaysia Government Bond** | 4,64 % | 07.11.2033 | 1.741.005 | 0,33 |
| 14.051.000 | Malaysia Government Bond** | 4,70 % | 15.10.2042 | 3.292.745 | 0,63 |
| 2.800.000 | Malaysia Government Bond** | 4,76 % | 07.04.2037 | 657.305 | 0,12 |
| 9.290.000 | Malaysia Government Bond** | 4,89 % | 08.06.2038 | 2.220.550 | 0,42 |
| 2.400.000 | Malaysia Government Bond** | 4,94 % | 30.09.2043 | 570.840 | 0,11 |
| 10.000.000 | Malaysia Government Investment Issue** | 4,07 % | 30.09.2026 | 2.204.177 | 0,42 |
| 5.000.000 | Malaysia Government Investment Issue** | 4,37 % | 31.10.2028 | 1.120.846 | 0,21 |
| Malaysischer Ringgit insgesamt | | | | 24.205.015 | 4,60 |
| Mexikanischer Peso | | | | | |
| 69.430.000 | Mexican Bonos* | 5,50 % | 04.03.2027 | 3.678.074 | 0,70 |
| 33.480.000 | Mexican Bonos* | 7,50 % | 26.05.2033 | 1.804.958 | 0,34 |

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 62,75 % (31. Dezember 2022: 61,28 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Mexikanischer Peso (Fortsetzung) | | | | | |
| 99.104.600 | Mexican Bonos* | 7,75 % | 29.05.2031 | 5.462.004 | 1,04 |
| 54.428.300 | Mexican Bonos* | 7,75 % | 13.11.2042 | 2.829.648 | 0,54 |
| 4.130.800 | Mexican Bonos* | 8,00 % | 07.11.2047 | 218.201 | 0,04 |
| 89.439.100 | Mexican Bonos* | 8,50 % | 31.05.2029 | 5.171.512 | 0,98 |
| 38.862.000 | Mexican Bonos* | 8,50 % | 18.11.2038 | 2.190.679 | 0,41 |
| 4.890.000 | Mexican Bonos* | 10,00 % | 20.11.2036 | 311.286 | 0,06 |
| Mexikanischer Peso insgesamt | | | | 21.666.362 | 4,11 |
| Peruanischer Sol | | | | | |
| 12.864.000 | Fondo MIVIVIENDA SA* | 7,00 % | 14.02.2024 | 3.457.639 | 0,66 |
| 2.110.000 | Peru Government Bond* | 5,35 % | 12.08.2040 | 488.586 | 0,09 |
| 2.604.000 | Peru Government Bond* | 5,40 % | 12.08.2034 | 636.089 | 0,12 |
| 9.927.000 | Peru Government Bond* | 6,15 % | 12.08.2032 | 2.619.737 | 0,50 |
| 3.885.000 | Peru Government Bond* | 7,30 % | 12.08.2033 | 1.100.721 | 0,21 |
| 3.153.000 | Peruvian Government International Bond* | 5,40 % | 12.08.2034 | 770.195 | 0,14 |
| 3.429.000 | Peruvian Government International Bond** | 6,90 % | 12.08.2037 | 934.561 | 0,18 |
| 60.000 | Peruvian Government International Bond** | 8,20 % | 12.08.2026 | 17.205 | 0,00 |
| Peruanischer Sol insgesamt | | | | 10.024.733 | 1,90 |
| Philippinischer Peso | | | | | |
| 58.120.000 | Philippine Government Bond* | 6,75 % | 15.09.2032 | 1.105.103 | 0,21 |
| Philippinischer Peso insgesamt | | | | 1.105.103 | 0,21 |
| Polnischer Zloty | | | | | |
| 7.316.000 | Republic of Poland Government Bond* | 0,25 % | 25.10.2026 | 1.636.001 | 0,31 |
| 8.251.000 | Republic of Poland Government Bond** | 1,25 % | 25.10.2030 | 1.661.718 | 0,31 |
| 29.163.000 | Republic of Poland Government Bond* | 1,75 % | 25.04.2032 | 5.771.771 | 1,09 |
| 18.217.000 | Republic of Poland Government Bond* | 2,50 % | 25.07.2026 | 4.364.256 | 0,83 |
| 4.556.000 | Republic of Poland Government Bond** | 2,75 % | 25.04.2028 | 1.063.007 | 0,20 |
| 6.668.000 | Republic of Poland Government Bond* | 2,75 % | 25.10.2029 | 1.514.830 | 0,29 |
| 9.216.000 | Republic of Poland Government Bond* | 3,75 % | 25.05.2027 | 2.259.051 | 0,43 |
| 5.192.000 | Republic of Poland Government Bond* | 6,00 % | 25.10.2033 | 1.401.251 | 0,27 |
| 24.822.000 | Republic of Poland Government Bond* | 7,50 % | 25.07.2028 | 6.951.105 | 1,32 |
| Polnischer Zloty insgesamt | | | | 26.622.990 | 5,05 |
| Rumänischer neuer Leu | | | | | |
| 12.060.000 | Romania Government Bond* | 2,50 % | 25.10.2027 | 2.350.285 | 0,44 |
| 3.670.000 | Romania Government Bond* | 3,65 % | 24.09.2031 | 687.262 | 0,13 |
| 1.085.000 | Romania Government Bond* | 4,75 % | 11.10.2034 | 212.687 | 0,04 |
| 7.770.000 | Romania Government Bond** | 4,85 % | 25.07.2029 | 1.620.189 | 0,31 |

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 62,75 % (31. Dezember 2022: 61,28 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Rumänischer neuer Leu (Fortsetzung) | | | | | |
| 1.190.000 | Romania Government Bond* | 5,00 % | 12.02.2029 | 250.432 | 0,05 |
| 2.735.000 | Romania Government Bond* | 6,70 % | 25.02.2032 | 626.425 | 0,12 |
| 630.000 | Romania Government Bond* | 7,35 % | 28.04.2031 | 148.990 | 0,03 |
| 985.000 | Romania Government Bond* | 7,90 % | 24.02.2038 | 252.981 | 0,05 |
| 1.085.000 | Romania Government Bond* | 8,00 % | 29.04.2030 | 262.925 | 0,05 |
| 4.215.000 | Romania Government Bond* | 8,25 % | 29.09.2032 | 1.058.937 | 0,20 |
| 3.525.000 | Romania Government Bond* | 8,75 % | 30.10.2028 | 863.273 | 0,16 |
| Rumänischer neuer Leu insgesamt | | | | 8.334.386 | 1,58 |
| Serbischer Dinar | | | | | |
| 15.020.000 | Serbia Treasury Bonds* | 4,50 % | 11.01.2026 | 139.402 | 0,03 |
| 24.630.000 | Serbia Treasury Bonds* | 4,50 % | 20.08.2032 | 206.255 | 0,04 |
| 46.430.000 | Serbia Treasury Bonds* | 5,88 % | 08.02.2028 | 444.867 | 0,08 |
| Serbischer Dinar insgesamt | | | | 790.524 | 0,15 |
| Südafrikanischer Rand | | | | | |
| 113.833.220 | Republic of South Africa Government Bond* | 6,25 % | 31.03.2036 | 4.091.771 | 0,78 |
| 25.675.679 | Republic of South Africa Government Bond* | 6,50 % | 28.02.2041 | 849.842 | 0,16 |
| 113.551.464 | Republic of South Africa Government Bond* | 7,00 % | 28.02.2031 | 5.200.548 | 0,99 |
| 132.785.468 | Republic of South Africa Government Bond* | 8,50 % | 31.01.2037 | 5.689.354 | 1,08 |
| 47.130.129 | Republic of South Africa Government Bond* | 8,75 % | 31.01.2044 | 1.914.585 | 0,36 |
| 70.099.452 | Republic of South Africa Government Bond* | 8,75 % | 28.02.2048 | 2.827.744 | 0,54 |
| 62.637.569 | Republic of South Africa Government Bond* | 9,00 % | 31.01.2040 | 2.685.666 | 0,51 |
| 49.303.416 | Republic of South Africa Government Bond* | 10,50 % | 21.12.2026 | 2.825.022 | 0,53 |
| Südafrikanischer Rand insgesamt | | | | 26.084.532 | 4,95 |
| Thailändischer Baht | | | | | |
| 150.162.000 | Thailand Government Bond** | 1,45 % | 17.12.2024 | 4.362.585 | 0,83 |
| 3.425.000 | Thailand Government Bond* | 1,59 % | 17.12.2035 | 88.836 | 0,02 |
| 17.000.000 | Thailand Government Bond** | 1,60 % | 17.12.2029 | 472.711 | 0,09 |
| 10.000.000 | Thailand Government Bond** | 1,60 % | 17.06.2035 | 260.794 | 0,05 |
| 31.800.000 | Thailand Government Bond** | 2,00 % | 17.06.2042 | 795.187 | 0,15 |
| 17.000.000 | Thailand Government Bond** | 2,40 % | 17.03.2029 | 496.682 | 0,09 |
| 8.831.000 | Thailand Government Bond** | 2,88 % | 17.06.2046 | 237.296 | 0,04 |
| 53.284.000 | Thailand Government Bond** | 3,30 % | 17.06.2038 | 1.630.163 | 0,31 |
| 90.384.000 | Thailand Government Bond** | 3,35 % | 17.06.2033 | 2.791.358 | 0,53 |
| 37.300.000 | Thailand Government Bond** | 3,39 % | 17.06.2037 | 1.157.719 | 0,22 |
| 55.278.000 | Thailand Government Bond** | 3,40 % | 17.06.2036 | 1.711.068 | 0,32 |
| 42.200.000 | Thailand Government Bond** | 3,45 % | 17.06.2043 | 1.297.357 | 0,25 |
| 13.380.000 | Thailand Government Bond** | 3,78 % | 25.06.2032 | 423.705 | 0,08 |

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 62,75 % (31. Dezember 2022: 61,28 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Thailändischer Baht (Fortsetzung) | | | | | |
| 47.595.000 | Thailand Government Bond** | 4,88 % | 22.06.2029 | 1.562.276 | 0,30 |
| Thailändischer Baht insgesamt | | | | 17.287.737 | 3,28 |
| Türkische Lira | | | | | |
| 74.210.173 | Turkey Government Bond* | 1,50 % | 18.06.2025 | 2.640.851 | 0,50 |
| 12.481.091 | Turkiye Government Bond* | 17,80 % | 13.07.2033 | 331.742 | 0,06 |
| 37.301.788 | Turkiye Government Bond* | 26,20 % | 05.10.2033 | 1.313.532 | 0,25 |
| Türkische Lira insgesamt | | | | 4.286.125 | 0,81 |
| Uganda-Schilling | | | | | |
| 4.469.700.000 | Republic of Uganda Government Bonds* | 14,25 % | 22.06.2034 | 1.119.625 | 0,21 |
| Uganda-Schilling insgesamt | | | | 1.119.625 | 0,21 |
| US-Dollar | | | | | |
| 1.431.000 | Angolan Government International Bond* | 8,75 % | 14.04.2032 | 1.262.460 | 0,24 |
| 310.000 | Angolan Government International Bond* | 9,13 % | 26.11.2049 | 253.812 | 0,05 |
| 1.877.000 | Angolan Government International Bond* | 9,38 % | 08.05.2048 | 1.566.878 | 0,30 |
| 3.696.488 | Argentine Republic Government International Bond* | 0,75 % | 09.07.2030 | 1.491.558 | 0,28 |
| 470.000 | Argentine Republic Government International Bond* | 1,00 % | 09.07.2029 | 188.940 | 0,04 |
| 7.482.174 | Argentine Republic Government International Bond* | 3,63 % | 09.07.2035 | 2.585.579 | 0,49 |
| 690.000 | Bahamas Government International Bond* | 6,00 % | 21.11.2028 | 614.100 | 0,12 |
| 240.000 | Bank Gospodarstwa Krajowego* | 5,38 % | 22.05.2033 | 243.847 | 0,05 |
| 1.049.000 | Bermuda Government International Bond* | 5,00 % | 15.07.2032 | 1.043.230 | 0,20 |
| 1.056.000 | Brazilian Government International Bond* | 5,00 % | 27.01.2045 | 864.826 | 0,16 |
| 290.000 | Brazilian Government International Bond* | 5,63 % | 07.01.2041 | 268.788 | 0,05 |
| 200.000 | Brazilian Government International Bond* | 5,63 % | 21.02.2047 | 176.323 | 0,03 |
| 665.000 | Brazilian Government International Bond* | 6,00 % | 20.10.2033 | 666.460 | 0,13 |
| 310.000 | Brazilian Government International Bond** | 6,25 % | 18.03.2031 | 322.121 | 0,06 |
| 200.000 | Brazilian Government International Bond* | 8,25 % | 20.01.2034 | 235.976 | 0,04 |
| 417.000 | Chile Government International Bond* | 3,25 % | 21.09.2071 | 281.009 | 0,05 |
| 250.000 | Colombia Government International Bond* | 3,00 % | 30.01.2030 | 211.605 | 0,04 |
| 950.000 | Colombia Government International Bond* | 5,00 % | 15.06.2045 | 740.397 | 0,14 |
| 2.403.000 | Colombia Government International Bond* | 5,20 % | 15.05.2049 | 1.885.074 | 0,36 |
| 635.000 | Colombia Government International Bond* | 6,13 % | 18.01.2041 | 579.272 | 0,11 |
| 1.010.000 | Colombia Government International Bond* | 7,50 % | 02.02.2034 | 1.068.607 | 0,20 |
| 625.000 | Colombia Government International Bond* | 8,00 % | 20.04.2033 | 682.828 | 0,13 |
| 224.000 | Colombia Government International Bond** | 8,00 % | 14.11.2035 | 245.499 | 0,05 |
| 200.000 | Colombia Government International Bond* | 8,75 % | 14.11.2053 | 230.451 | 0,04 |
| 561.000 | Corp Financiera de Desarrollo SA* | 5,25 % | 15.07.2029 | 556.313 | 0,11 |
| 285.000 | Costa Rica Government International Bond* | 6,55 % | 03.04.2034 | 295.866 | 0,06 |
| 162.000 | Costa Rica Government International Bond* | 7,16 % | 12.03.2045 | 172.368 | 0,03 |

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 62,75 % (31. Dezember 2022: 61,28 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 786.000 | Costa Rica Government International Bond* | 7,30 % | 13.11.2054 | 854.775 | 0,16 |
| 2.174.000 | Dominican Republic International Bond* | 5,88 % | 30.01.2060 | 1.885.934 | 0,36 |
| 795.000 | Dominican Republic International Bond* | 6,00 % | 22.02.2033 | 786.056 | 0,15 |
| 314.000 | Dominican Republic International Bond* | 6,40 % | 05.06.2049 | 296.337 | 0,06 |
| 219.000 | Dominican Republic International Bond* | 6,50 % | 15.02.2048 | 209.419 | 0,04 |
| 187.000 | Dominican Republic International Bond* | 6,85 % | 27.01.2045 | 186.891 | 0,04 |
| 34.209 | Ecuador Government International Bond* | 0,00 % | 31.07.2030 | 9.843 | 0,00 |
| 658.547 | Ecuador Government International Bond* | 2,50 % | 31.07.2040 | 210.735 | 0,04 |
| 4.699.354 | Ecuador Government International Bond* | 3,50 % | 31.07.2035 | 1.693.350 | 0,32 |
| 611.432 | Ecuador Government International Bond* | 6,00 % | 31.07.2030 | 285.728 | 0,05 |
| 240.000 | Egypt Government International Bond* | 8,15 % | 20.11.2059 | 148.151 | 0,03 |
| 2.150.000 | Egypt Government International Bond* | 8,70 % | 01.03.2049 | 1.352.576 | 0,26 |
| 1.280.000 | Egypt Government International Bond* | 8,88 % | 29.05.2050 | 819.313 | 0,16 |
| 550.000 | El Salvador Government International Bond* | 7,65 % | 15.06.2035 | 431.062 | 0,08 |
| 3.219.000 | El Salvador Government International Bond* | 9,50 % | 15.07.2052 | 2.696.072 | 0,51 |
| 600.000 | Ethiopia International Bond* | 6,63 % | 11.12.2024 | 407.794 | 0,08 |
| 210.000 | Ghana Government International Bond* | 7,88 % | 26.03.2027 | 94.355 | 0,02 |
| 494.000 | Ghana Government International Bond* | 8,63 % | 07.04.2034 | 216.956 | 0,04 |
| 311.000 | Ghana Government International Bond* | 8,95 % | 26.03.2051 | 135.111 | 0,03 |
| 3.119.000 | Ghana Government International Bond* | 10,75 % | 14.10.2030 | 1.974.720 | 0,37 |
| 203.000 | Guatemala Government Bond* | 3,70 % | 07.10.2033 | 169.886 | 0,03 |
| 200.000 | Guatemala Government Bond* | 6,13 % | 01.06.2050 | 190.000 | 0,04 |
| 1.223.000 | Guatemala Government Bond* | 6,60 % | 13.06.2036 | 1.262.748 | 0,24 |
| 335.000 | Guatemala Government Bond* | 7,05 % | 04.10.2032 | 356.817 | 0,07 |
| 551.000 | Honduras Government International Bond* | 5,63 % | 24.06.2030 | 492.456 | 0,09 |
| 351.000 | Honduras Government International Bond* | 6,25 % | 19.01.2027 | 337.837 | 0,06 |
| 140.000 | Indonesia Government International Bond* | 8,50 % | 12.10.2035 | 186.550 | 0,04 |
| 173.813 | Iraq International Bond* | 5,80 % | 15.01.2028 | 162.944 | 0,03 |
| 360.000 | Istanbul Metropolitan Municipality* | 10,50 % | 06.12.2028 | 382.950 | 0,07 |
| 200.000 | Jordan Government International Bond* | 7,38 % | 10.10.2047 | 178.321 | 0,03 |
| 1.235.000 | Lebanon Government International Bond* | 6,38 % | 09.03.2020 | 75.644 | 0,01 |
| 3.089.000 | Lebanon Government International Bond* | 6,60 % | 27.11.2026 | 190.011 | 0,04 |
| 878.000 | Lebanon Government International Bond* | 6,65 % | 26.02.2030 | 55.017 | 0,01 |
| 965.000 | Lebanon Government International Bond* | 6,85 % | 25.05.2029 | 59.678 | 0,01 |
| 7.131.000 | Lebanon Government International Bond* | 8,25 % | 17.05.2034 | 444.083 | 0,08 |
| 1.720.000 | Mexico Government International Bond* | 5,75 % | 12.10.2110 | 1.545.722 | 0,29 |
| 201.000 | Mongolia Government International Bond* | 3,50 % | 07.07.2027 | 179.863 | 0,03 |
| 200.000 | Mongolia Government International Bond* | 5,13 % | 07.04.2026 | 194.482 | 0,04 |
| 263.000 | Mongolia Government International Bond* | 7,88 % | 05.06.2029 | 269.310 | 0,05 |
| 943.000 | Mongolia Government International Bond* | 8,65 % | 19.01.2028 | 989.497 | 0,19 |
| 411.000 | Morocco Government International Bond* | 3,00 % | 15.12.2032 | 339.118 | 0,06 |

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 62,75 % (31. Dezember 2022: 61,28 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 400.000 | Morocco Government International Bond* | 6,50 % | 08.09.2033 | 422.841 | 0,08 |
| 627.000 | Nigeria Government International Bond* | 7,88 % | 16.02.2032 | 565.397 | 0,11 |
| 421.000 | Nigeria Government International Bond* | 8,25 % | 28.09.2051 | 346.710 | 0,07 |
| 806.000 | Nigeria Government International Bond* | 8,75 % | 21.01.2031 | 770.911 | 0,15 |
| 588.000 | Nigeria Government International Bond* | 9,25 % | 21.01.2049 | 531.187 | 0,10 |
| 1.930.000 | Oman Government International Bond* | 6,75 % | 17.01.2048 | 2.024.126 | 0,38 |
| 316.000 | Oman Government International Bond* | 7,00 % | 25.01.2051 | 341.806 | 0,06 |
| 213.000 | Panama Government International Bond* | 4,30 % | 29.04.2053 | 143.208 | 0,03 |
| 906.000 | Panama Government International Bond* | 4,50 % | 01.04.2056 | 610.726 | 0,12 |
| 380.000 | Panama Government International Bond* | 4,50 % | 19.01.2063 | 249.551 | 0,05 |
| 930.000 | Panama Government International Bond* | 6,40 % | 14.02.2035 | 910.068 | 0,17 |
| 200.000 | Panama Government International Bond* | 6,85 % | 28.03.2054 | 187.633 | 0,04 |
| 200.000 | Panama Government International Bond* | 6,88 % | 31.01.2036 | 200.053 | 0,04 |
| 485.000 | Papua New Guinea Government International Bond* | 8,38 % | 04.10.2028 | 463.902 | 0,09 |
| 448.000 | Paraguay Government International Bond* | 5,40 % | 30.03.2050 | 399.504 | 0,08 |
| 663.000 | Paraguay Government International Bond* | 5,60 % | 13.03.2048 | 606.365 | 0,11 |
| 610.000 | Provincia de Buenos Aires* | 6,38 % | 01.09.2037 | 235.134 | 0,04 |
| 242.114 | Provincia de Cordoba* | 6,88 % | 10.12.2025 | 220.369 | 0,04 |
| 751.000 | Republic of Armenia International Bond* | 3,60 % | 02.02.2031 | 615.954 | 0,12 |
| 1.450.000 | Republic of Azerbaijan International Bond* | 5,13 % | 01.09.2029 | 1.427.279 | 0,27 |
| 497.000 | Republic of Poland Government International Bond* | 5,50 % | 04.04.2053 | 519.512 | 0,10 |
| 1.846.000 | Republic of South Africa Government International Bond* | 5,75 % | 30.09.2049 | 1.479.754 | 0,28 |
| 922.000 | Republic of South Africa Government International Bond* | 7,30 % | 20.04.2052 | 875.813 | 0,17 |
| 250.000 | Romanian Government International Bond* | 7,63 % | 17.01.2053 | 280.910 | 0,05 |
| 473.000 | Sri Lanka Government International Bond* | 6,20 % | 11.05.2027 | 240.191 | 0,05 |
| 2.816.000 | Sri Lanka Government International Bond* | 6,75 % | 18.04.2028 | 1.423.652 | 0,27 |
| 1.075.000 | Sri Lanka Government International Bond* | 6,83 % | 18.07.2026 | 552.976 | 0,10 |
| 1.196.000 | Sri Lanka Government International Bond* | 6,85 % | 14.03.2024 | 609.034 | 0,12 |
| 1.913.000 | Sri Lanka Government International Bond* | 6,85 % | 03.11.2025 | 989.973 | 0,19 |
| 629.000 | Sri Lanka Government International Bond* | 7,55 % | 28.03.2030 | 317.564 | 0,06 |
| 524.000 | State Agency of Roads of Ukraine* | 6,25 % | 24.06.2030 | 135.061 | 0,03 |
| 870.000 | Turkiye Government International Bond* | 9,13 % | 13.07.2030 | 962.368 | 0,18 |
| 378.000 | Turkiye Government International Bond* | 9,38 % | 14.03.2029 | 418.945 | 0,08 |
| 217.000 | Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS* | 9,38 % | 31.01.2026 | 227.436 | 0,04 |
| 1.782.000 | Ukraine Government International Bond* | 6,88 % | 21.05.2031 | 415.562 | 0,08 |
| 179.000 | Ukraine Government International Bond* | 7,75 % | 01.09.2027 | 49.515 | 0,01 |
| 1.921.000 | Ukraine Government International Bond* | 7,75 % | 01.08.2041 | 866.577 | 0,16 |
| 621.000 | Uzbekneftegaz JSC* | 4,75 % | 16.11.2028 | 518.800 | 0,10 |
| 7.776.600 | Venezuela Government International Bond* | 8,25 % | 13.10.2024 | 1.222.673 | 0,23 |
| 660.000 | Zambia Government International Bond* | 5,38 % | 20.09.2022 | 371.042 | 0,07 |

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|--|---------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 62,75 % (31. Dezember 2022: 61,28 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 2.076.000 | Zambia Government International Bond* | 8,97 % | 30.07.2027 | 1.292.061 | 0,24 |
| US-Dollar insgesamt | | | | 66.534.442 | 12,63 |
| Uruguayischer Peso | | | | | |
| 12.166.818 | Uruguay Government International Bond* | 8,25 % | 21.05.2031 | 288.962 | 0,06 |
| 93.003.000 | Uruguay Government International Bond* | 8,50 % | 15.03.2028 | 2.299.743 | 0,44 |
| 8.758.973 | Uruguay Government International Bond* | 9,75 % | 20.07.2033 | 227.085 | 0,04 |
| Uruguayischer Peso insgesamt | | | | 2.815.790 | 0,54 |
| Sambischer Kwacha | | | | | |
| 68.483.000 | Zambia Government Bond* | 13,00 % | 25.01.2031 | 1.720.200 | 0,33 |
| Sambischer Kwacha insgesamt | | | | 1.720.200 | 0,33 |
| Staatsanleihen insgesamt | | | | 330.568.106 | 62,75 |
| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | | | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Investmentfonds 2,72 % (31. Dezember 2022: 2,84 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 1.409.964 | Neuberger Berman China Bond Fund | | | 14.297.035 | 2,72 |
| Investmentfonds insgesamt ^a | | | | 14.297.035 | 2,72 |
| Anlagen insgesamt | | | | 493.949.385 | 93,77 |

Devisenterminkontrakte 1,26 % (31. Dezember 2022: 0,86 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeits- datum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettover- mögens |
|-----------------------|------------------------|-----------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| 5.403.668 BRL | 1.089.467 US\$ | 03.04.2024 | Citibank NA | 1 | 13.600 | 0,00 |
| 12.554.008 BRL | 2.551.161 US\$ | 20.02.2024 | Morgan Stanley | 1 | 22.094 | 0,00 |
| 150.531.314 BRL | 30.302.624 US\$ | 03.04.2024 | Morgan Stanley | 1 | 425.779 | 0,08 |
| 1.239.369.244 CLP | 1.399.879 US\$ | 20.03.2024 | Morgan Stanley | 1 | 13.637 | 0,00 |
| 23.159.545 CNY | 3.261.278 US\$ | 20.03.2024 | Barclays Bank Plc | 1 | 8.689 | 0,00 |
| 5.986.231 CNY | 843.389 US\$ | 20.02.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 118 | 0,00 |
| 23.159.545 CNY | 3.261.431 US\$ | 20.03.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | 8.536 | 0,00 |
| 1.471.347.925 COP | 367.926 US\$ | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 6.011 | 0,00 |
| 81.295.166 EGP | 2.368.050 US\$ | 17.01.2024 | Citibank NA | 1 | 43.482 | 0,01 |
| 5.594.962 € | 137.190.928 CZK | 20.03.2024 | Barclays Bank Plc | 1 | 74.070 | 0,01 |
| 5.277.364 € | 5.761.791 US\$ | 04.01.2024 | Barclays Bank Plc | 3 | 68.074 | 0,01 |
| 1.063.835 € | 4.630.073 PLN | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | 2.637 | 0,00 |
| 2.596.222 € | 2.843.950 US\$ | 04.01.2024 | Citibank NA | 2 | 24.077 | 0,01 |
| 2.420.976 € | 2.654.028 US\$ | 04.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | 20.406 | 0,00 |

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 1,26 % (31. Dezember 2022: 0,86 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 1.193.794 € | 5.199.448 PLN | 20.03.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | 2.004 | 0,00 |
| 2.272.426 € | 2.468.332 US\$ | 17.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 43.355 | 0,01 |
| 1.593.159 € | 6.930.568 PLN | 20.03.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 4.776 | 0,00 |
| 845.153 € | 925.406 US\$ | 04.01.2024 | Morgan Stanley | 1 | 8.228 | 0,00 |
| 169.636.422 HUF | 440.014 € | 06.02.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 1.124 | 0,00 |
| 163.043.725 HUF | 423.112 € | 06.02.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 861 | 0,00 |
| 9.857.431.615 IDR | 629.955 US\$ | 07.02.2024 | BNP Paribas | 1 | 9.403 | 0,00 |
| 19.713.013.706 IDR | 1.249.280 US\$ | 07.02.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | 29.316 | 0,01 |
| 1.130.476 ILS | 304.876 US\$ | 25.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 9.205 | 0,00 |
| 207.011.159 INR | 2.483.134 US\$ | 22.01.2024 | Citibank NA | 1 | 2.297 | 0,00 |
| 106.212.688 INR | 1.273.196 US\$ | 08.02.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 1.130 | 0,00 |
| 1.684.447.172 KRW | 1.298.455 US\$ | 20.03.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 6.529 | 0,00 |
| 1.707.662.945 KRW | 1.295.841 US\$ | 16.01.2024 | Morgan Stanley | 1 | 21.653 | 0,00 |
| 3.302.310.926 KRW | 2.509.774 US\$ | 22.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 39.211 | 0,01 |
| 1.706.928.097 KRW | 1.315.012 US\$ | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 7.388 | 0,00 |
| 94.214.997 MXN | 5.349.038 US\$ | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | 144.583 | 0,03 |
| 5.649.036 MXN | 326.365 US\$ | 20.03.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | 3.027 | 0,00 |
| 14.863.927 MXN | 840.786 US\$ | 20.03.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | 25.920 | 0,01 |
| 44.347.597 MXN | 2.539.627 US\$ | 20.02.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 57.987 | 0,01 |
| 5.758.963 MYR | 1.218.441 US\$ | 23.01.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | 38.910 | 0,01 |
| 14.883.772 MYR | 3.208.747 US\$ | 20.03.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 54.964 | 0,01 |
| 6.062.404 MYR | 1.298.771 US\$ | 11.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 23.640 | 0,01 |
| 12.644.946 MYR | 2.727.265 US\$ | 07.03.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 43.278 | 0,01 |
| 9.433.937 PEN | 2.467.227 US\$ | 18.01.2024 | Barclays Bank Plc | 1 | 79.454 | 0,02 |
| 70.120.397 PHP | 1.251.426 US\$ | 06.02.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | 14.415 | 0,00 |
| 3.150.745 RON | 631.523 € | 19.01.2024 | Citibank NA | 1 | 1.399 | 0,00 |
| 4.072.805 RON | 816.523 € | 19.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 1.603 | 0,00 |
| 1.658.544 SGD | 1.219.383 US\$ | 22.01.2024 | Morgan Stanley | 1 | 39.121 | 0,01 |
| 43.788.780 THB | 1.258.501 US\$ | 22.01.2024 | Citibank NA | 1 | 26.687 | 0,01 |
| 184.243.696 THB | 5.293.968 US\$ | 20.03.2024 | Goldman Sachs International | 3 | 140.255 | 0,03 |
| 100.121.321 THB | 2.875.769 US\$ | 20.03.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 77.285 | 0,02 |
| 46.397.101 THB | 1.298.620 US\$ | 16.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 62.290 | 0,01 |
| 91.089.188 THB | 2.596.865 US\$ | 08.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 72.890 | 0,01 |
| 81.585.541 TWD | 2.564.373 US\$ | 12.01.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | 112.587 | 0,02 |
| 41.130.425 TWD | 1.312.939 US\$ | 08.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 33.591 | 0,01 |
| 17.547.195 US\$ | 15.859.544 € | 02.02.2024 | Citibank NA | 2 | 5.372 | 0,00 |
| 1.525.721 US\$ | 28.016.034 ZAR | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | 4.119 | 0,00 |
| 890.685 US\$ | 49.233.512 PHP | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | 1.933 | 0,00 |
| 97.152 US\$ | 124.294.446 KRW | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | 858 | 0,00 |
| 1.328.262 US\$ | 1.719.939.972 KRW | 16.01.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | 1.296 | 0,00 |

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 1,26 % (31. Dezember 2022: 0,86 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 1.242.320 US\$ | 1.608.617.394 KRW | 22.01.2024 | Morgan Stanley | 1 | 662 | 0,00 |
| 52.176.725 UYU | 1.302.790 US\$ | 27.03.2024 | Citibank NA | 1 | 22.839 | 0,00 |
| 37.479.491 UYU | 934.746 US\$ | 09.02.2024 | Citibank NA | 2 | 22.707 | 0,00 |
| 8.828.681 UYU | 217.992 US\$ | 09.02.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 7.546 | 0,00 |
| 35.527.584 UYU | 878.007 US\$ | 09.02.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | 29.582 | 0,01 |
| 26.353.226 ZAR | 1.385.169 US\$ | 20.03.2024 | Morgan Stanley | 1 | 46.123 | 0,01 |
| 45.917.508 ZAR | 2.485.790 US\$ | 22.01.2024 | Morgan Stanley | 1 | 20.776 | 0,00 |
| 5.381.279 ZAR | 291.200 US\$ | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 1.067 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> | | | | | | |
| 4.028.207 AUD | 2.659.930 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | 94.705 | 0,02 |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 176.462.740 € | 191.291.954 US\$ | 14.03.2024 | Goldman Sachs International | 4 | 4.199.321 | 0,81 |
| 4.230.001 € | 4.663.789 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 8 | 22.347 | 0,00 |
| 49.928 US\$ | 44.832 € | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 4 | 263 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 6.633.345 £ | 8.366.366 US\$ | 14.03.2024 | UBS AG | 3 | 92.872 | 0,02 |
| 188.091 £ | 238.067 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 12 | 1.796 | 0,00 |
| 231 US\$ | 181 £ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | 0 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen NOK</i> | | | | | | |
| 130.008 NOK | 11.911 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | 912 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i> | | | | | | |
| 155.502 SEK | 14.911 US\$ | 14.03.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 562 | 0,00 |
| 17.565.158 SEK | 1.682.959 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | 64.917 | 0,01 |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i> | | | | | | |
| 2.087.683 SGD | 1.564.098 US\$ | 14.03.2024 | Goldman Sachs International | 3 | 23.792 | 0,00 |
| 268 SGD | 200 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | 3 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | 6.637.946 | 1,26 |

Futures-Kontrakte 0,23 % (31. Dezember 2022: 0,25 %)

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|--|--------------------------------|----------------------|
| 70 | Euro-BOBL Future March 2024 | 215.631 | 0,04 |
| 10 | South Korea 10-Year Bond Future March 2024 | 11.880 | 0,00 |
| 118 | South Korea 3-Year Bond Future March 2024 | 29.319 | 0,01 |
| 74 | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2024 | 272.711 | 0,05 |
| 20 | US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2024 | 45.156 | 0,01 |
| 57 | US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2024 | 105.070 | 0,02 |
| 35 | US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2024 | 285.031 | 0,05 |
| 19 | US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2024 | 234.563 | 0,05 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten * | | 1.199.361 | 0,23 |

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Zinsswap-Kontrakte 0,50 % (31. Dezember 2022: 1,03 %)

| | Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei | Erhalt/(Zahlung) [#] | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|----------------|------------|--|-------------------------------|-----------------|--------------------|--------------------------------|----------------------|
| CLP | 3.154.502.226 | 05.06.2030 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | Erhalt | 2,33 % | 1D CLICP | 485.600 | 0,09 |
| MXN | 96.923.155 | 31.08.2029 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | Erhalt | 6,92 % | 28D MXIBTIIE | 405.436 | 0,08 |
| BRL | 17.142.169 | 04.01.2027 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | (Zahlung) | 12,76 % | 1D BROIS | 340.580 | 0,07 |
| BRL | 13.941.828 | 04.01.2027 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | (Zahlung) | 12,67 % | 1D BROIS | 266.352 | 0,05 |
| BRL | 9.439.141 | 04.01.2027 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | (Zahlung) | 12,68 % | 1D BROIS | 181.570 | 0,04 |
| MXN | 63.783.049 | 01.01.2032 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | Erhalt | 7,64 % | 28D MXIBTIIE | 175.540 | 0,03 |
| BRL | 34.632.671 | 02.01.2026 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | (Zahlung) | 11,57 % | 1D BROIS | 146.066 | 0,03 |
| BRL | 16.274.019 | 02.01.2026 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 11,06 % | 1D BROIS | 87.788 | 0,02 |
| BRL | 3.909.270 | 04.01.2027 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | (Zahlung) | 13,02 % | 1D BROIS | 86.349 | 0,02 |
| COP | 14.710.158.205 | 31.01.2027 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | Erhalt | 7,14 % | 1D COOVIBR | 73.097 | 0,01 |
| BRL | 19.663.289 | 02.01.2026 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 10,59 % | 1D BROIS | 70.488 | 0,01 |
| COP | 20.252.351.381 | 13.04.2024 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | Erhalt | 8,37 % | 1D COOVIBR | 54.031 | 0,01 |
| MXN | 29.184.713 | 30.10.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 9,26 % | 28D MXIBTIIE | 46.197 | 0,01 |
| BRL | 6.581.593 | 02.01.2031 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 10,49 % | 1D BROIS | 38.305 | 0,01 |
| COP | 3.561.060.874 | 06.01.2027 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | Erhalt | 6,40 % | 1D COOVIBR | 35.890 | 0,01 |
| BRL | 8.615.804 | 02.01.2031 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 10,43 % | 1D BROIS | 25.248 | 0,01 |
| CZK | 245.067.618 | 22.12.2025 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 4,47 % | 6M PRIBOR | 21.157 | 0,00 |
| MXN | 27.580.600 | 17.08.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 8,94 % | 28D MXIBTIIE | 20.053 | 0,00 |
| MXN | 27.580.600 | 17.08.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 8,91 % | 28D MXIBTIIE | 18.190 | 0,00 |
| COP | 1.516.059.531 | 07.01.2027 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | Erhalt | 6,45 % | 1D COOVIBR | 14.717 | 0,00 |
| BRL | 8.384.051 | 04.01.2027 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 10,17 % | 1D BROIS | 13.396 | 0,00 |
| MXN | 37.047.081 | 20.03.2025 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | Erhalt | 10,05 % | 28D MXIBTIIE | 12.470 | 0,00 |
| CZK | 10.317.097 | 25.07.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 4,19 % | 6M PRIBOR | 11.411 | 0,00 |
| CNY | 20.200.000 | 29.08.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 2,30 % | 7D CNRR | 7.118 | 0,00 |
| CZK | 1.248.614 | 16.10.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 4,30 % | 6M PRIBOR | 1.715 | 0,00 |
| CNY | 16.400.000 | 11.12.2026 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 2,25 % | 7D CNRR | 1.670 | 0,00 |
| CNY | 19.000.000 | 16.08.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 2,28 % | 7D CNRR | 777 | 0,00 |
| MYR | 16.534.909 | 20.12.2025 | Goldman Sachs International | (Zahlung) | 3,50 % | 3M KLIBOR | 701 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten [∞] | | | | | | | 2.641.912 | 0,50 |

[#]Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

¹Zentral abgewickelter Swap.

| | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|--------------------|----------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 504.428.604 | 95,76 |

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,39 %) (31. Dezember 2022: (0,44 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 2.083.051.058 CLP | 2.377.288 US\$ | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | (1.541) | (0,00) |
| 1.905.868 CNY | 268.688 US\$ | 20.02.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | (136) | (0,00) |
| 18.955.714 CNY | 2.664.067 US\$ | 10.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | (588) | (0,00) |
| 49.202.797 EGP | 1.120.793 US\$ | 02.04.2024 | Citibank NA | 1 | (6.347) | (0,00) |
| 8.682.847 EGP | 199.148 US\$ | 02.04.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (2.481) | (0,00) |
| 15.859.544 € | 17.526.540 US\$ | 03.01.2024 | Citibank NA | 2 | (7.293) | (0,00) |
| 75.975 € | 378.948 RON | 19.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (146) | (0,00) |
| 920.404.140 HUF | 2.401.910 € | 06.02.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (9.946) | (0,00) |
| 1.608.617.394 KRW | 1.248.878 US\$ | 22.01.2024 | Citibank NA | 1 | (7.220) | (0,00) |
| 5.377.524 PLN | 1.233.769 € | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | (1.063) | (0,00) |
| 2.133.212 PLN | 489.973 € | 20.03.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (1.030) | (0,00) |
| 1.265.959 RON | 254.293 € | 19.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (44) | (0,00) |
| 23.090 US\$ | 163.971 CNY | 20.03.2024 | Barclays Bank Plc | 1 | (62) | (0,00) |
| 5.024.108 US\$ | 4.591.636 € | 05.02.2024 | Barclays Bank Plc | 1 | (55.146) | (0,01) |
| 3.018.592 US\$ | 2.783.875 € | 04.01.2024 | Barclays Bank Plc | 3 | (56.734) | (0,01) |
| 122.842 US\$ | 4.252.407 THB | 20.03.2024 | BNP Paribas | 1 | (2.582) | (0,00) |
| 1.021.692 US\$ | 930.000 € | 03.01.2024 | Brown Brothers Harriman | 1 | (5.632) | (0,00) |
| 4.086.435 US\$ | 15.703.354 PEN | 18.01.2024 | Citibank NA | 1 | (152.669) | (0,03) |
| 536.520 US\$ | 9.441.073 MXN | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | (13.983) | (0,00) |
| 1.202.152 US\$ | 1.638.347 SGD | 22.01.2024 | Citibank NA | 1 | (41.027) | (0,01) |
| 1.340.045 US\$ | 46.702.839 THB | 16.01.2024 | Citibank NA | 1 | (29.833) | (0,01) |
| 2.181.734 US\$ | 15.920.947 CNY | 10.01.2024 | Citibank NA | 1 | (55.328) | (0,01) |
| 2.492.297 US\$ | 2.272.426 € | 17.01.2024 | Citibank NA | 1 | (19.390) | (0,00) |
| 3.258.338 US\$ | 2.967.502 € | 05.02.2024 | Citibank NA | 2 | (24.305) | (0,01) |
| 2.022.974 US\$ | 72.612.319 EGP | 17.01.2024 | Citibank NA | 2 | (130.991) | (0,03) |
| 76.618 US\$ | 100.020.484 KRW | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | (870) | (0,00) |
| 9.733.566 US\$ | 39.674.988.141 COP | 20.03.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (349.685) | (0,07) |
| 5.290.833 US\$ | 21.455.334.544 COP | 01.02.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (211.778) | (0,04) |
| 478.589 US\$ | 8.285.760 MXN | 20.03.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (4.549) | (0,00) |
| 1.248.184 US\$ | 43.788.780 THB | 22.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (37.004) | (0,01) |
| 482.539 US\$ | 440.778 € | 03.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (4.366) | (0,00) |
| 3.090.560 US\$ | 2.858.636 € | 04.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (67.355) | (0,01) |
| 398.680 US\$ | 1.849.318 MYR | 20.03.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | (6.838) | (0,00) |
| 144.506 US\$ | 188.623.490 KRW | 20.03.2024 | HSBC Bank Plc | 2 | (1.625) | (0,00) |
| 654.069 US\$ | 3.265.313 BRL | 03.04.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | (12.489) | (0,00) |
| 23.091 US\$ | 163.971 CNY | 20.03.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | (60) | (0,00) |
| 1.065.056 US\$ | 16.516.241.760 IDR | 20.03.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | (5.958) | (0,00) |
| 2.049.814 US\$ | 83.437.674 UYU | 09.02.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | (81.689) | (0,02) |
| 248.081 US\$ | 8.682.847 EGP | 17.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (9.486) | (0,00) |
| 1.188.899 US\$ | 5.631.814 MYR | 23.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (40.692) | (0,01) |
| 527.669 US\$ | 2.445.483 MYR | 20.03.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (8.576) | (0,00) |

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (0,39 %) (31. Dezember 2022: (0,44 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 268.900 US\$ | 4.174.945.833 IDR | 07.02.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (1.889) | (0,00) |
| 2.860.957 US\$ | 53.668.021 ZAR | 20.03.2024 | Morgan Stanley | 2 | (53.852) | (0,01) |
| 6.012.522 US\$ | 5.497.203 € | 04.01.2024 | Morgan Stanley | 3 | (60.199) | (0,01) |
| 2.245.001 US\$ | 8.406.405 PEN | 18.01.2024 | Morgan Stanley | 1 | (24.300) | (0,01) |
| 1.319.202 US\$ | 40.914.125 TWD | 08.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | (20.247) | (0,00) |
| 10.590.995 US\$ | 75.692.969 CNY | 20.02.2024 | Standard Chartered Bank | 2 | (74.745) | (0,01) |
| 15.858.684 US\$ | 14.488.766 € | 03.01.2024 | Standard Chartered Bank | 2 | (146.333) | (0,03) |
| 340.835 US\$ | 2.417.057 CNY | 20.03.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | (436) | (0,00) |
| 2.198.333 US\$ | 34.404.574.910 IDR | 20.03.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | (32.668) | (0,01) |
| 2.552.974 US\$ | 81.697.729 TWD | 12.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | (127.667) | (0,02) |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 3.408.905 US\$ | 3.119.584 € | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 21 | (47.073) | (0,01) |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 78.786 £ | 100.595 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | (122) | (0,00) |
| 107.947 US\$ | 85.532 £ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 12 | (1.128) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i> | | | | | | |
| 931 SEK | 94 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | (1) | (0,00) |
| 426.246 US\$ | 4.444.614 SEK | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 14 | (16.029) | (0,00) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ^{oo} | | | | | (2.075.226) | (0,39) |

Futures-Kontrakte (0,19 %) (31. Dezember 2022: (0,03 %))

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|--|---------------------------------|----------------------|
| (75) | Euro-Bund Future March 2024 | (267.480) | (0,05) |
| (23) | Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2024 | (216.865) | (0,04) |
| (3) | Euro-Schatz Future March 2024 | (1.508) | (0,00) |
| (31) | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2024 | (127.391) | (0,03) |
| (20) | US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2024 | (200.937) | (0,04) |
| (12) | US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2024 | (155.344) | (0,03) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten * | | (969.525) | (0,19) |

Zinsswap-Kontrakte (1,10 %) (31. Dezember 2022: (2,46 %))

| Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei | Erhalt/(Zahlung) [#] | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------------|------------|-------------------------------|-------------------------------|-----------------|--------------------|---------------------------------|----------------------|
| INR 259.567.091 | 19.12.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 6,21 % | 1D MIBOR | (86) | (0,00) |
| CLP 1.516.255.404 | 24.10.2033 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 6,12 % | 1D CLICP | (188) | (0,00) |

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Zinsswap-Kontrakte (1,10 %) (31. Dezember 2022: (2,46 %)) (Fortsetzung)

| | Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei | Erhalt/(Zahlung) [#] | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|----------------|------------|--|-------------------------------|-----------------|--------------------|---------------------------------|----------------------|
| COP | 2.600.024.896 | 02.06.2025 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | Erhalt | 10,28 % | 1D COOVIBR | (7.619) | (0,00) |
| PLN | 6.696.569 | 07.11.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 4,51 % | 6M WIBOR | (7.720) | (0,00) |
| BRL | 5.917.558 | 02.01.2029 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 10,30 % | 1D BROIS | (11.042) | (0,00) |
| BRL | 26.290.456 | 02.01.2026 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 10,00 % | 1D BROIS | (14.260) | (0,00) |
| MXN | 54.330.570 | 03.02.2028 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | (Zahlung) | 8,58 % | 28D MXIBTIE | (15.188) | (0,00) |
| PLN | 4.719.181 | 10.10.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 4,76 % | 6M WIBOR | (17.693) | (0,00) |
| PLN | 6.556.235 | 01.12.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 4,72 % | 6M WIBOR | (21.471) | (0,00) |
| PLN | 1.621.573 | 15.05.2033 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 5,20 % | 6M WIBOR | (22.577) | (0,00) |
| PLN | 1.621.573 | 15.05.2033 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 5,22 % | 6M WIBOR | (23.121) | (0,01) |
| PLN | 3.422.027 | 02.10.2033 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 4,99 % | 6M WIBOR | (34.484) | (0,01) |
| MXN | 9.645.130 | 08.12.2025 | Goldman Sachs International | (Zahlung) | 6,21 % | 28D MXIBTIE | (35.993) | (0,01) |
| MXN | 63.984.030 | 27.05.2027 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | (Zahlung) | 8,58 % | 28D MXIBTIE | (38.024) | (0,01) |
| MXN | 28.121.151 | 07.01.2028 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | (Zahlung) | 8,04 % | 28D MXIBTIE | (39.125) | (0,01) |
| PLN | 4.495.017 | 03.10.2033 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 5,01 % | 6M WIBOR | (47.109) | (0,01) |
| COP | 20.939.092.335 | 05.06.2025 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | Erhalt | 10,27 % | 1D COOVIBR | (61.519) | (0,01) |
| CLP | 2.479.849.388 | 14.09.2024 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | Erhalt | 9,80 % | 1D CLICP | (61.535) | (0,01) |
| CLP | 2.698.258.379 | 13.04.2025 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | Erhalt | 7,51 % | 1D CLICP | (66.958) | (0,01) |
| COP | 3.223.342.325 | 11.08.2032 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | Erhalt | 9,02 % | 1D COOVIBR | (72.298) | (0,01) |
| BRL | 3.954.742 | 02.01.2031 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 11,45 % | 1D BROIS | (80.002) | (0,02) |
| PLN | 2.553.479 | 30.09.2032 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 6,86 % | 6M WIBOR | (110.462) | (0,02) |
| BRL | 5.332.502 | 02.01.2031 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 11,54 % | 1D BROIS | (115.588) | (0,02) |
| CLP | 1.254.313.506 | 23.01.2030 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | (Zahlung) | 3,06 % | 1D CLICP | (127.014) | (0,02) |
| MXN | 37.080.494 | 05.03.2026 | Goldman Sachs International | (Zahlung) | 6,17 % | 28D MXIBTIE | (147.727) | (0,03) |
| MXN | 29.276.180 | 08.10.2038 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 9,77 % | 28D MXIBTIE | (185.524) | (0,04) |
| MXN | 47.500.000 | 18.06.2026 | JPMorgan Chase Bank | (Zahlung) | 6,13 % | 28D MXIBTIE | (201.227) | (0,04) |
| CLP | 3.115.406.937 | 23.06.2025 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | (Zahlung) | 1,16 % | 1D CLICP | (223.034) | (0,04) |
| CLP | 3.388.538.669 | 17.06.2025 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | (Zahlung) | 1,36 % | 1D CLICP | (229.934) | (0,04) |
| CLP | 1.377.149.008 | 24.08.2030 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | (Zahlung) | 2,15 % | 1D CLICP | (235.992) | (0,05) |
| MXN | 60.000.000 | 16.09.2026 | Goldman Sachs International | (Zahlung) | 6,38 % | 28D MXIBTIE | (242.882) | (0,05) |
| BRL | 29.000.000 | 04.01.2027 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | (Zahlung) | 7,67 % | 1D BROIS | (960.482) | (0,18) |
| BRL | 68.736.587 | 02.01.2024 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | (Zahlung) | 4,84 % | 1D BROIS | (2.347.047) | (0,45) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten [∞] | | | | | | | (5.804.925) | (1,10) |

[#]Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

¹Zentral abgewickelter Swap.

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--------------------|------------------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (8.849.676) | (1,68) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | 495.578.928 | 94,08 |
| Sonstiges Nettovermögen | 31.208.879 | 5,92 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | 526.787.807 | 100,00 |

| Portfolioanalyse | US\$ | % des Gesamtver- mögens |
|---|--------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 362.702.107 | 67,41 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 116.950.243 | 21,74 |
| μ Investmentfonds | 14.297.035 | 2,66 |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 229.836 | 0,04 |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap | 1.399.707 | 0,26 |
| Anlagen insgesamt | 495.578.928 | 92,11 |

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Schatzwechsel 1,26 % (31. Dezember 2022: 0,00 %) | | | | | |
| Thailändischer Baht | | | | | |
| 1.300.000 | Bank of Thailand Bill | 0,00 % | 09.05.2024 | 37.793 | 0,06 |
| Thailändischer Baht insgesamt | | | | 37.793 | 0,06 |
| US-Dollar | | | | | |
| 785.200 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 18.01.2024 | 783.358 | 1,20 |
| US-Dollar insgesamt | | | | 783.358 | 1,20 |
| Schatzwechsel insgesamt ** | | | | 821.151 | 1,26 |
| Unternehmensanleihen 14,20 % (31. Dezember 2022: 13,84 %) | | | | | |
| Kolumbianischer Peso | | | | | |
| 73.000.000 | Asian Development Bank* | 11,20 % | 31.01.2025 | 18.679 | 0,03 |
| 191.000.000 | Asian Development Bank* | 12,75 % | 03.03.2025 | 49.959 | 0,08 |
| 205.000.000 | Asian Development Bank* | 13,00 % | 07.03.2025 | 53.399 | 0,08 |
| 270.000.000 | International Finance Corp* | 0,00 % | 16.08.2028 | 45.178 | 0,07 |
| Kolumbianischer Peso insgesamt | | | | 167.215 | 0,26 |
| Euro | | | | | |
| 100.000 | Banque Ouest Africaine de Developpement* | 2,75 % | 22.01.2033 | 85.072 | 0,13 |
| Euro insgesamt | | | | 85.072 | 0,13 |
| Mexikanischer Peso | | | | | |
| 3.000.000 | Asian Infrastructure Investment Bank* | 0,00 % | 08.02.2038 | 48.823 | 0,08 |
| Mexikanischer Peso insgesamt | | | | 48.823 | 0,08 |
| US-Dollar | | | | | |
| 200.000 | Abu Dhabi Commercial Bank PJSC* | 3,50 % | 31.03.2027 | 190.572 | 0,29 |
| 200.000 | Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC* | 4,60 % | 02.11.2047 | 184.066 | 0,28 |
| 200.000 | African Export-Import Bank* | 2,63 % | 17.05.2026 | 184.960 | 0,28 |
| 200.000 | African Export-Import Bank* | 3,80 % | 17.05.2031 | 170.093 | 0,26 |
| 200.000 | African Export-Import Bank* | 3,99 % | 21.09.2029 | 179.302 | 0,28 |
| 200.000 | Banco de Credito e Inversiones SA* | 3,50 % | 12.10.2027 | 189.313 | 0,29 |
| 200.000 | Bank Leumi Le-Israel BM** | 3,28 % | 29.01.2031 | 181.290 | 0,28 |
| 200.000 | Bank Mandiri Persero Tbk PT** | 4,75 % | 13.05.2025 | 198.753 | 0,31 |
| 880.000 | Banque Ouest Africaine de Developpement* | 4,70 % | 22.10.2031 | 752.039 | 1,16 |
| 205.000 | Banque Ouest Africaine de Developpement* | 5,00 % | 27.07.2027 | 191.393 | 0,29 |
| 200.000 | Cencosud SA* | 4,38 % | 17.07.2027 | 193.093 | 0,30 |
| 300.000 | Corp Nacional del Cobre de Chile* | 3,15 % | 14.01.2030 | 268.314 | 0,41 |
| 200.000 | Corp Nacional del Cobre de Chile* | 3,70 % | 30.01.2050 | 144.757 | 0,22 |
| 200.000 | Corp Nacional del Cobre de Chile* | 5,95 % | 08.01.2034 | 203.274 | 0,31 |

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 14,20 % (31. Dezember 2022: 13,84 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 200.000 | DIB Sukuk Ltd* | 4,80 % | 16.08.2028 | 198.604 | 0,31 |
| 200.000 | DP World Ltd* | 6,85 % | 02.07.2037 | 221.251 | 0,34 |
| 240.000 | Emirates NBD Bank PJSC* | 5,88 % | 11.10.2028 | 248.410 | 0,38 |
| 436.000 | Empresa de los Ferrocarriles del Estado* | 3,83 % | 14.09.2061 | 299.936 | 0,46 |
| 200.000 | Empresa de Transmision Electrica SA* | 5,13 % | 02.05.2049 | 145.369 | 0,22 |
| 200.000 | ENN Energy Holdings Ltd** | 2,63 % | 17.09.2030 | 171.295 | 0,26 |
| 203.000 | First Abu Dhabi Bank PJSC* | 5,13 % | 13.10.2027 | 204.766 | 0,31 |
| 200.000 | Gabon Blue Bond Master Trust Series 2† | 6,10 % | 01.08.2038 | 196.788 | 0,30 |
| 400.000 | LG Chem Ltd* | 2,38 % | 07.07.2031 | 331.641 | 0,51 |
| 250.000 | Malaysia Wakala Sukuk Bhd* | 3,08 % | 28.04.2051 | 192.017 | 0,29 |
| 200.000 | MDGH GMTN RSC Ltd* | 2,50 % | 03.06.2031 | 173.932 | 0,27 |
| 200.000 | MDGH GMTN RSC Ltd* | 3,38 % | 28.03.2032 | 183.250 | 0,28 |
| 200.000 | MTR Corp Ltd** | 1,63 % | 19.08.2030 | 167.141 | 0,26 |
| 292.000 | NBK SPC Ltd* | 1,63 % | 15.09.2027 | 264.798 | 0,41 |
| 200.000 | NBK Tier 1 Ltd* | 3,63 % | 29.12.2049 | 180.710 | 0,28 |
| 200.000 | Ooredoo International Finance Ltd* | 2,63 % | 08.04.2031 | 174.739 | 0,27 |
| 400.000 | Shinhan Bank Co Ltd* | 4,00 % | 23.04.2029 | 373.756 | 0,57 |
| 200.000 | Shinhan Financial Group Co Ltd* | 3,34 % | 05.02.2030 | 194.910 | 0,30 |
| 200.000 | Sigma Alimentos SA de CV* | 4,13 % | 02.05.2026 | 195.115 | 0,30 |
| 200.000 | Sigma Finance Netherlands BV* | 4,88 % | 27.03.2028 | 196.535 | 0,30 |
| 200.000 | SK Hynix Inc* | 6,50 % | 17.01.2033 | 211.311 | 0,33 |
| 1.000.000 | Tencent Holdings Ltd* | 3,24 % | 03.06.2050 | 667.707 | 1,03 |
| 220.000 | TSMC Arizona Corp* | 3,25 % | 25.10.2051 | 174.453 | 0,27 |
| 400.000 | UltraTech Cement Ltd* | 2,80 % | 16.02.2031 | 338.843 | 0,52 |
| US-Dollar insgesamt | | | | 8.938.496 | 13,73 |
| Unternehmensanleihen insgesamt | | | | 9.239.606 | 14,20 |
| Staatsanleihen 74,18 % (31. Dezember 2022: 77,91 %) | | | | | |
| Chilenischer Peso | | | | | |
| 91.994.100 | Bonos de la Tesoreria de la Republica* | 1,90 % | 01.09.2030 | 103.546 | 0,16 |
| 55.000.000 | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 2,80 % | 01.10.2033 | 51.578 | 0,08 |
| 40.000.000 | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 4,50 % | 01.03.2026 | 45.706 | 0,07 |
| 25.000.000 | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 4,70 % | 01.09.2030 | 28.051 | 0,04 |
| 35.000.000 | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 5,00 % | 01.03.2035 | 40.076 | 0,06 |
| 45.000.000 | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 6,00 % | 01.04.2033 | 55.020 | 0,09 |
| 20.000.000 | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 6,00 % | 01.01.2043 | 25.592 | 0,04 |
| 15.000.000 | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 7,00 % | 01.05.2034 | 19.696 | 0,03 |
| Chilenischer Peso insgesamt | | | | 369.265 | 0,57 |

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 74,18 % (31. Dezember 2022: 77,91 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Kolumbianischer Peso | | | | | |
| 773.800.000 | Colombian TES* | 5,75 % | 03.11.2027 | 177.071 | 0,27 |
| 1.201.800.000 | Colombian TES* | 6,00 % | 28.04.2028 | 273.864 | 0,42 |
| 1.001.800.000 | Colombian TES* | 7,00 % | 26.03.2031 | 223.232 | 0,34 |
| 1.452.700.000 | Colombian TES* | 7,00 % | 30.06.2032 | 314.483 | 0,49 |
| 335.400.000 | Colombian TES* | 7,25 % | 18.10.2034 | 71.331 | 0,11 |
| 1.209.700.000 | Colombian TES* | 7,75 % | 18.09.2030 | 284.813 | 0,44 |
| 32.300.000 | Colombian TES* | 9,25 % | 28.05.2042 | 7.571 | 0,01 |
| 849.700.000 | Colombian TES* | 13,25 % | 09.02.2033 | 260.509 | 0,40 |
| Kolumbianischer Peso insgesamt | | | | 1.612.874 | 2,48 |
| Tschechische Krone | | | | | |
| 2.810.000 | Czech Republic Government Bond* | 0,05 % | 29.11.2029 | 101.722 | 0,16 |
| 4.070.000 | Czech Republic Government Bond* | 0,25 % | 10.02.2027 | 162.883 | 0,25 |
| 3.080.000 | Czech Republic Government Bond* | 0,95 % | 15.05.2030 | 116.624 | 0,18 |
| 9.220.000 | Czech Republic Government Bond* | 1,20 % | 13.03.2031 | 348.223 | 0,54 |
| 680.000 | Czech Republic Government Bond* | 1,50 % | 24.04.2040 | 21.906 | 0,03 |
| 1.730.000 | Czech Republic Government Bond* | 1,75 % | 23.06.2032 | 66.724 | 0,10 |
| 1.870.000 | Czech Republic Government Bond* | 1,95 % | 30.07.2037 | 67.464 | 0,10 |
| 3.410.000 | Czech Republic Government Bond* | 2,00 % | 13.10.2033 | 131.363 | 0,20 |
| 270.000 | Czech Republic Government Bond* | 2,50 % | 25.08.2028 | 11.470 | 0,02 |
| 720.000 | Czech Republic Government Bond* | 4,20 % | 04.12.2036 | 33.567 | 0,05 |
| 490.000 | Czech Republic Government Bond* | 5,00 % | 30.09.2030 | 23.599 | 0,04 |
| 590.000 | Czech Republic Government Bond* | 5,50 % | 12.12.2028 | 28.651 | 0,04 |
| 130.000 | Czech Republic Government Bond* | 6,20 % | 16.06.2031 | 6.784 | 0,01 |
| Tschechische Krone insgesamt | | | | 1.120.980 | 1,72 |
| Euro | | | | | |
| 410.000 | Bank Gospodarstwa Krajowego* | 5,13 % | 22.02.2033 | 493.509 | 0,76 |
| 200.000 | Bulgaria Government International Bond* | 4,13 % | 23.09.2029 | 227.850 | 0,35 |
| 233.000 | Bulgaria Government International Bond* | 4,38 % | 13.05.2031 | 270.833 | 0,42 |
| 180.000 | Bulgaria Government International Bond* | 4,50 % | 27.01.2033 | 209.286 | 0,32 |
| 750.000 | Chile Government International Bond* | 0,83 % | 02.07.2031 | 687.119 | 1,06 |
| 648.092 | Chile Government International Bond* | 4,13 % | 05.07.2034 | 732.846 | 1,13 |
| 453.000 | Hungary Government International Bond* | 1,63 % | 28.04.2032 | 407.920 | 0,63 |
| 750.000 | Indonesia Government International Bond* | 0,90 % | 14.02.2027 | 762.132 | 1,17 |
| 400.000 | Indonesia Government International Bond* | 1,10 % | 12.03.2033 | 350.705 | 0,54 |
| 2.210.000 | Indonesia Government International Bond* | 1,40 % | 30.10.2031 | 2.075.878 | 3,19 |
| 400.000 | Kazakhstan Government International Bond* | 0,60 % | 30.09.2026 | 412.752 | 0,63 |
| 1.000.000 | Kazakhstan Government International Bond* | 1,50 % | 30.09.2034 | 885.582 | 1,36 |

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 74,18 % (31. Dezember 2022: 77,91 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Euro (Fortsetzung) | | | | | |
| 940.000 | Kazakhstan Government International Bond* | 2,38 % | 09.11.2028 | 1.002.137 | 1,54 |
| 350.000 | Latvia Government International Bond* | 0,25 % | 23.01.2030 | 325.305 | 0,50 |
| 250.000 | Lithuania Government International Bond* | 2,13 % | 01.06.2032 | 254.284 | 0,39 |
| 298.000 | Peruvian Government International Bond* | 1,25 % | 11.03.2033 | 259.199 | 0,40 |
| 200.000 | Peruvian Government International Bond* | 1,95 % | 17.11.2036 | 167.135 | 0,26 |
| 1.000.000 | Philippine Government International Bond* | 0,70 % | 03.02.2029 | 967.668 | 1,49 |
| 200.000 | Philippine Government International Bond* | 1,20 % | 28.04.2033 | 177.899 | 0,27 |
| 1.050.000 | Philippine Government International Bond* | 1,75 % | 28.04.2041 | 813.733 | 1,25 |
| 276.000 | Republic of Poland Government International Bond* | 4,25 % | 14.02.2043 | 322.320 | 0,49 |
| 437.000 | Romanian Government International Bond* | 2,00 % | 14.04.2033 | 362.660 | 0,56 |
| 37.000 | Romanian Government International Bond* | 2,88 % | 13.04.2042 | 27.745 | 0,04 |
| 400.000 | Romanian Government International Bond** | 3,38 % | 08.02.2038 | 346.934 | 0,53 |
| 1.825.000 | Romanian Government International Bond* | 3,75 % | 07.02.2034 | 1.743.252 | 2,68 |
| 633.000 | Romanian Government International Bond* | 3,88 % | 29.10.2035 | 598.099 | 0,92 |
| 247.000 | Romanian Government International Bond* | 6,38 % | 18.09.2033 | 289.087 | 0,44 |
| Euro insgesamt | | | | 15.173.869 | 23,32 |
| Ungarischer Forint | | | | | |
| 31.830.000 | Hungary Government Bond* | 3,00 % | 27.10.2027 | 83.867 | 0,13 |
| 12.750.000 | Hungary Government Bond* | 3,00 % | 21.08.2030 | 31.615 | 0,05 |
| 12.620.000 | Hungary Government Bond* | 3,25 % | 22.10.2031 | 31.016 | 0,05 |
| 99.900.000 | Hungary Government Bond* | 4,50 % | 23.03.2028 | 275.272 | 0,42 |
| 47.650.000 | Hungary Government Bond* | 4,75 % | 24.11.2032 | 127.058 | 0,19 |
| 27.140.000 | Hungary Government Bond* | 5,50 % | 24.06.2025 | 77.573 | 0,12 |
| 17.610.000 | Hungary Government Bond* | 6,75 % | 22.10.2028 | 52.850 | 0,08 |
| 35.350.000 | Hungary Government Bond* | 9,50 % | 21.10.2026 | 110.745 | 0,17 |
| Ungarischer Forint insgesamt | | | | 789.996 | 1,21 |
| Indonesische Rupiah | | | | | |
| 4.000.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 5,13 % | 15.04.2027 | 250.408 | 0,38 |
| 1.050.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 5,50 % | 15.04.2026 | 66.919 | 0,10 |
| 300.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 6,25 % | 15.06.2036 | 18.950 | 0,03 |
| 7.512.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 6,38 % | 15.08.2028 | 487.348 | 0,75 |
| 2.700.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 6,38 % | 15.04.2032 | 172.968 | 0,27 |
| 300.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 6,38 % | 15.07.2037 | 19.244 | 0,03 |
| 5.406.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 6,50 % | 15.02.2031 | 349.685 | 0,54 |
| 186.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 6,63 % | 15.05.2033 | 12.123 | 0,02 |
| 2.880.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 6,63 % | 15.02.2034 | 187.209 | 0,29 |
| 5.700.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 6,88 % | 15.04.2029 | 376.165 | 0,58 |

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|----------------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 74,18 % (31. Dezember 2022: 77,91 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Indonesische Rupie (Fortsetzung) | | | | | |
| 300.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 7,00 % | 15.05.2027 | 19.818 | 0,03 |
| 8.726.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 7,00 % | 15.02.2033 | 587.825 | 0,90 |
| 3.670.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 7,13 % | 15.06.2038 | 249.815 | 0,38 |
| 1.109.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 7,13 % | 15.06.2042 | 74.963 | 0,12 |
| 1.753.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 7,13 % | 15.06.2043 | 118.391 | 0,18 |
| 3.550.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 7,50 % | 15.06.2035 | 244.321 | 0,38 |
| 1.791.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 7,50 % | 15.04.2040 | 124.253 | 0,19 |
| 222.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 8,25 % | 15.05.2036 | 16.213 | 0,02 |
| 100.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 8,38 % | 15.03.2034 | 7.264 | 0,01 |
| 131.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 8,38 % | 15.04.2039 | 9.755 | 0,01 |
| Indonesische Rupiah insgesamt | | | | 3.393.637 | 5,21 |
| Malaysischer Ringgit | | | | | |
| 645.000 | Malaysia Government Bond** | 2,63 % | 15.04.2031 | 129.698 | 0,20 |
| 710.000 | Malaysia Government Bond** | 3,50 % | 31.05.2027 | 154.078 | 0,24 |
| 570.000 | Malaysia Government Bond** | 3,58 % | 15.07.2032 | 121.747 | 0,19 |
| 690.000 | Malaysia Government Bond** | 3,73 % | 15.06.2028 | 150.636 | 0,23 |
| 923.000 | Malaysia Government Bond** | 3,76 % | 22.05.2040 | 192.265 | 0,30 |
| 265.000 | Malaysia Government Bond** | 3,83 % | 05.07.2034 | 57.320 | 0,09 |
| 1.550.000 | Malaysia Government Bond** | 3,90 % | 16.11.2027 | 340.696 | 0,52 |
| 70.000 | Malaysia Government Bond** | 3,90 % | 30.11.2026 | 15.400 | 0,02 |
| 70.000 | Malaysia Government Bond** | 3,91 % | 15.07.2026 | 15.394 | 0,02 |
| 400.000 | Malaysia Government Bond** | 4,07 % | 15.06.2050 | 85.495 | 0,13 |
| 350.000 | Malaysia Government Bond** | 4,25 % | 31.05.2035 | 78.095 | 0,12 |
| 700.000 | Malaysia Government Bond** | 4,50 % | 15.04.2030 | 158.871 | 0,24 |
| 850.000 | Malaysia Government Bond** | 4,50 % | 30.04.2029 | 192.384 | 0,30 |
| 516.000 | Malaysia Government Bond** | 4,64 % | 07.11.2033 | 120.617 | 0,18 |
| 1.356.000 | Malaysia Government Bond** | 4,70 % | 15.10.2042 | 317.768 | 0,49 |
| 520.000 | Malaysia Government Bond** | 4,76 % | 07.04.2037 | 122.071 | 0,19 |
| 513.000 | Malaysia Government Bond** | 4,89 % | 08.06.2038 | 122.620 | 0,19 |
| Malaysischer Ringgit insgesamt | | | | 2.375.155 | 3,65 |
| Mexikanischer Peso | | | | | |
| 1.760.000 | Mexican Bonos* | 5,50 % | 04.03.2027 | 93.237 | 0,15 |
| 11.896.000 | Mexican Bonos* | 7,50 % | 03.06.2027 | 665.760 | 1,02 |
| 3.850.000 | Mexican Bonos* | 7,50 % | 26.05.2033 | 207.559 | 0,32 |
| 20.465.900 | Mexican Bonos* | 7,75 % | 29.05.2031 | 1.127.948 | 1,74 |
| 5.919.800 | Mexican Bonos* | 7,75 % | 13.11.2042 | 307.762 | 0,47 |

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 74,18 % (31. Dezember 2022: 77,91 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Mexikanischer Peso (Fortsetzung) | | | | | |
| 1.503.800 | Mexican Bonos* | 8,00 % | 07.11.2047 | 79.435 | 0,12 |
| 12.734.000 | Mexican Bonos* | 8,50 % | 31.05.2029 | 736.300 | 1,13 |
| Mexikanischer Peso insgesamt | | | | 3.218.001 | 4,95 |
| Peruanischer Sol | | | | | |
| 199.000 | Peru Government Bond* | 5,35 % | 12.08.2040 | 46.080 | 0,07 |
| 86.000 | Peru Government Bond* | 5,40 % | 12.08.2034 | 21.008 | 0,03 |
| 843.000 | Peru Government Bond* | 6,15 % | 12.08.2032 | 222.468 | 0,34 |
| 253.000 | Peru Government Bond* | 7,30 % | 12.08.2033 | 71.681 | 0,11 |
| 56.000 | Peruvian Government International Bond* | 5,40 % | 12.08.2034 | 13.679 | 0,02 |
| 724.000 | Peruvian Government International Bond** | 6,90 % | 12.08.2037 | 197.324 | 0,31 |
| Peruanischer Sol insgesamt | | | | 572.240 | 0,88 |
| Philippinischer Peso | | | | | |
| 4.560.000 | Philippine Government Bond* | 6,75 % | 15.09.2032 | 86.705 | 0,13 |
| Philippinischer Peso insgesamt | | | | 86.705 | 0,13 |
| Polnischer Zloty | | | | | |
| 95.000 | Republic of Poland Government Bond* | 0,25 % | 25.10.2026 | 21.244 | 0,03 |
| 807.000 | Republic of Poland Government Bond** | 1,25 % | 25.10.2030 | 162.527 | 0,25 |
| 2.507.000 | Republic of Poland Government Bond* | 1,75 % | 25.04.2032 | 496.171 | 0,76 |
| 414.000 | Republic of Poland Government Bond* | 2,50 % | 25.07.2026 | 99.182 | 0,15 |
| 313.000 | Republic of Poland Government Bond* | 2,50 % | 25.07.2027 | 73.601 | 0,11 |
| 1.020.000 | Republic of Poland Government Bond* | 2,75 % | 25.10.2029 | 231.723 | 0,36 |
| 143.000 | Republic of Poland Government Bond** | 3,25 % | 25.07.2025 | 35.408 | 0,06 |
| 492.000 | Republic of Poland Government Bond* | 3,75 % | 25.05.2027 | 120.600 | 0,19 |
| 482.000 | Republic of Poland Government Bond* | 6,00 % | 25.10.2033 | 130.085 | 0,20 |
| 1.812.000 | Republic of Poland Government Bond* | 7,50 % | 25.07.2028 | 507.429 | 0,78 |
| Polnischer Zloty insgesamt | | | | 1.877.970 | 2,89 |
| Rumänischer neuer Leu | | | | | |
| 1.380.000 | Romania Government Bond* | 2,50 % | 25.10.2027 | 268.938 | 0,41 |
| 255.000 | Romania Government Bond* | 3,25 % | 24.06.2026 | 53.161 | 0,08 |
| 1.175.000 | Romania Government Bond** | 4,85 % | 25.07.2029 | 245.009 | 0,38 |
| 5.000 | Romania Government Bond* | 5,00 % | 12.02.2029 | 1.052 | 0,00 |
| 540.000 | Romania Government Bond* | 6,70 % | 25.02.2032 | 123.682 | 0,19 |
| 35.000 | Romania Government Bond* | 7,35 % | 28.04.2031 | 8.277 | 0,01 |
| 200.000 | Romania Government Bond* | 8,25 % | 29.09.2032 | 50.246 | 0,08 |

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 74,18 % (31. Dezember 2022: 77,91 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Rumänischer neuer Leu (Fortsetzung) | | | | | |
| 290.000 | Romania Government Bond* | 8,75 % | 30.10.2028 | 71.021 | 0,11 |
| Rumänischer neuer Leu insgesamt | | | | 821.386 | 1,26 |
| Thailändischer Baht | | | | | |
| 22.000.000 | Thailand Government Bond** | 0,75 % | 17.09.2024 | 637.606 | 0,98 |
| 1.500.000 | Thailand Government Bond** | 0,95 % | 17.06.2025 | 43.100 | 0,07 |
| 1.330.000 | Thailand Government Bond** | 1,45 % | 17.12.2024 | 38.640 | 0,06 |
| 5.388.000 | Thailand Government Bond* | 1,59 % | 17.12.2035 | 139.751 | 0,22 |
| 6.540.000 | Thailand Government Bond** | 1,60 % | 17.12.2029 | 181.855 | 0,28 |
| 2.430.000 | Thailand Government Bond** | 2,00 % | 17.12.2031 | 67.991 | 0,10 |
| 3.700.000 | Thailand Government Bond** | 2,00 % | 17.06.2042 | 92.522 | 0,14 |
| 800.000 | Thailand Government Bond** | 2,40 % | 17.03.2029 | 23.373 | 0,04 |
| 2.300.000 | Thailand Government Bond** | 2,65 % | 17.06.2028 | 68.017 | 0,10 |
| 250.000 | Thailand Government Bond** | 2,88 % | 17.12.2028 | 7.470 | 0,01 |
| 62.000 | Thailand Government Bond** | 2,88 % | 17.06.2046 | 1.666 | 0,00 |
| 3.332.000 | Thailand Government Bond** | 3,30 % | 17.06.2038 | 101.939 | 0,16 |
| 6.968.000 | Thailand Government Bond** | 3,35 % | 17.06.2033 | 215.195 | 0,33 |
| 5.400.000 | Thailand Government Bond** | 3,39 % | 17.06.2037 | 167.605 | 0,26 |
| 3.600.000 | Thailand Government Bond** | 3,45 % | 17.06.2043 | 110.675 | 0,17 |
| 200.000 | Thailand Government Bond** | 3,78 % | 25.06.2032 | 6.333 | 0,01 |
| Thailändischer Baht insgesamt | | | | 1.903.738 | 2,93 |
| US-Dollar | | | | | |
| 200.000 | Bank Gospodarstwa Krajowego* | 5,38 % | 22.05.2033 | 203.206 | 0,31 |
| 200.000 | Bank Gospodarstwa Krajowego* | 6,25 % | 31.10.2028 | 211.476 | 0,32 |
| 800.000 | Bermuda Government International Bond* | 3,72 % | 25.01.2027 | 777.000 | 1,19 |
| 400.000 | Bermuda Government International Bond* | 5,00 % | 15.07.2032 | 397.800 | 0,61 |
| 200.000 | Chile Government International Bond* | 3,25 % | 21.09.2071 | 134.776 | 0,21 |
| 200.000 | Chile Government International Bond* | 4,34 % | 07.03.2042 | 179.318 | 0,28 |
| 200.000 | Export-Import Bank of Korea* | 4,50 % | 15.09.2032 | 199.915 | 0,31 |
| 90.000 | Hungary Government International Bond* | 7,63 % | 29.03.2041 | 107.837 | 0,17 |
| 1.460.000 | Indonesia Government International Bond* | 8,50 % | 12.10.2035 | 1.945.450 | 2,99 |
| 359.000 | Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp* | 1,75 % | 15.04.2026 | 331.735 | 0,51 |
| 1.356.000 | Mexico Government International Bond* | 5,75 % | 12.10.2110 | 1.218.604 | 1,87 |
| 1.100.000 | Mexico Government International Bond* | 6,35 % | 09.02.2035 | 1.155.097 | 1,78 |
| 750.000 | Panama Bonos del Tesoro* | 6,38 % | 25.07.2033 | 704.625 | 1,08 |
| 200.000 | Panama Government International Bond* | 4,50 % | 01.04.2056 | 134.818 | 0,21 |
| 588.000 | Panama Government International Bond* | 4,50 % | 19.01.2063 | 386.148 | 0,59 |
| 400.000 | Panama Government International Bond* | 6,40 % | 14.02.2035 | 391.427 | 0,60 |

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 74,18 % (31. Dezember 2022: 77,91 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 1.808.000 | Panama Government International Bond* | 6,70 % | 26.01.2036 | 1.796.231 | 2,76 |
| 1.530.000 | Peruvian Government International Bond* | 8,75 % | 21.11.2033 | 1.930.147 | 2,97 |
| 200.000 | Philippine Government International Bond* | 6,38 % | 23.10.2034 | 227.051 | 0,35 |
| 260.000 | Philippine Government International Bond* | 9,50 % | 02.02.2030 | 327.763 | 0,50 |
| 100.000 | Republic of Poland Government International Bond* | 4,88 % | 04.10.2033 | 101.627 | 0,16 |
| 124.000 | Romanian Government International Bond* | 7,63 % | 17.01.2053 | 139.331 | 0,21 |
| 480.000 | UAE International Government Bond* | 4,95 % | 07.07.2052 | 472.835 | 0,73 |
| 600.000 | Uruguay Government International Bond* | 4,38 % | 23.01.2031 | 596.574 | 0,92 |
| 280.000 | Uruguay Government International Bond* | 5,10 % | 18.06.2050 | 281.845 | 0,43 |
| 300.000 | Uruguay Government International Bond* | 7,88 % | 15.01.2033 | 368.035 | 0,57 |
| US-Dollar insgesamt | | | | 14.720.671 | 22,63 |
| Uruguayischer Peso | | | | | |
| 938.196 | Uruguay Government International Bond* | 8,25 % | 21.05.2031 | 22.282 | 0,03 |
| 7.654.000 | Uruguay Government International Bond* | 8,50 % | 15.03.2028 | 189.265 | 0,29 |
| 714.753 | Uruguay Government International Bond* | 9,75 % | 20.07.2033 | 18.531 | 0,03 |
| Uruguayischer Peso insgesamt | | | | 230.078 | 0,35 |
| Staatsanleihen insgesamt | | | | 48.266.565 | 74,18 |
| Anlagen insgesamt | | | | 58.327.322 | 89,64 |

Devisenterminkontrakte 3,57 % (31. Dezember 2022: 0,83 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeits- datum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettöver- mögens |
|-----------------------|------------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| 100.865.485 CLP | 113.929 US\$ | 20.03.2024 | Morgan Stanley | 1 | 1.110 | 0,00 |
| 133.160 € | 3.265.141 CZK | 20.03.2024 | Barclays Bank Plc | 1 | 1.763 | 0,00 |
| 465.408 € | 509.243 US\$ | 05.02.2024 | Barclays Bank Plc | 1 | 5.590 | 0,01 |
| 403.886 € | 442.332 US\$ | 04.01.2024 | Barclays Bank Plc | 2 | 3.839 | 0,01 |
| 55.343 € | 240.866 PLN | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | 137 | 0,00 |
| 201.156 € | 217.235 US\$ | 03.01.2024 | Citibank NA | 1 | 4.972 | 0,01 |
| 213.992 € | 234.415 US\$ | 04.01.2024 | Citibank NA | 2 | 1.981 | 0,00 |
| 417.818 € | 455.057 US\$ | 04.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | 6.503 | 0,01 |
| 131.430 € | 571.746 PLN | 20.03.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 394 | 0,00 |
| 272.037 € | 295.489 US\$ | 17.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 5.190 | 0,01 |
| 19.416 € | 21.260 US\$ | 04.01.2024 | Morgan Stanley | 1 | 189 | 0,00 |
| 13.994.601 HUF | 36.300 € | 06.02.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 93 | 0,00 |
| 13.411.834 HUF | 34.805 € | 06.02.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 71 | 0,00 |
| 1.061.637.042 IDR | 67.846 US\$ | 07.02.2024 | BNP Paribas | 1 | 1.013 | 0,00 |
| 1.577.567.380 IDR | 99.976 US\$ | 07.02.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | 2.346 | 0,00 |
| 101.663 ILS | 27.417 US\$ | 25.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 828 | 0,00 |

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 3,57 % (31. Dezember 2022: 0,83 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 24.697.017 INR | 296.245 US\$ | 22.01.2024 | Citibank NA | 1 | 274 | 0,00 |
| 8.409.370 INR | 100.805 US\$ | 08.02.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 89 | 0,00 |
| 139.022.876 KRW | 107.166 US\$ | 20.03.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 539 | 0,00 |
| 140.921.999 KRW | 106.937 US\$ | 16.01.2024 | Morgan Stanley | 1 | 1.787 | 0,00 |
| 141.814.464 KRW | 109.253 US\$ | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 614 | 0,00 |
| 3.289.564 MXN | 186.764 US\$ | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | 5.048 | 0,01 |
| 2.002.084 MXN | 113.249 US\$ | 20.03.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | 3.491 | 0,01 |
| 5.420.572 MXN | 310.417 US\$ | 20.02.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 7.088 | 0,01 |
| 466.231 MYR | 98.642 US\$ | 23.01.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | 3.150 | 0,01 |
| 1.461.287 MYR | 315.034 US\$ | 20.03.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 5.396 | 0,01 |
| 493.330 MYR | 105.688 US\$ | 11.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 1.924 | 0,00 |
| 952.187 MYR | 205.368 US\$ | 07.03.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 3.259 | 0,01 |
| 694.601 PEN | 181.657 US\$ | 18.01.2024 | Barclays Bank Plc | 1 | 5.850 | 0,01 |
| 121.652 PEN | 32.244 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 595 | 0,00 |
| 203.151 PEN | 52.356 US\$ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 2.485 | 0,00 |
| 5.611.504 PHP | 100.147 US\$ | 06.02.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | 1.153 | 0,00 |
| 638.440 RON | 127.974 € | 19.01.2024 | Citibank NA | 2 | 275 | 0,00 |
| 338.343 RON | 67.832 € | 19.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 133 | 0,00 |
| 134.271 SGD | 98.718 US\$ | 22.01.2024 | Morgan Stanley | 1 | 3.167 | 0,01 |
| 1.385.060 THB | 40.011 US\$ | 20.03.2024 | BNP Paribas | 1 | 841 | 0,00 |
| 5.224.125 THB | 150.143 US\$ | 22.01.2024 | Citibank NA | 1 | 3.184 | 0,01 |
| 9.177.413 THB | 263.573 US\$ | 20.03.2024 | Goldman Sachs International | 2 | 7.113 | 0,01 |
| 7.505.966 THB | 213.988 US\$ | 08.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 6.006 | 0,01 |
| 3.828.842 THB | 107.166 US\$ | 16.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 5.140 | 0,01 |
| 3.103.288 THB | 89.135 US\$ | 20.03.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 2.395 | 0,00 |
| 6.613.403 TWD | 207.871 US\$ | 12.01.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | 9.126 | 0,01 |
| 3.402.426 TWD | 108.610 US\$ | 08.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 2.779 | 0,01 |
| 68.058 US\$ | 3.761.956 PHP | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | 148 | 0,00 |
| 11.448 US\$ | 14.645.933 KRW | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | 101 | 0,00 |
| 16.814.679 US\$ | 15.197.208 € | 02.02.2024 | Citibank NA | 1 | 5.449 | 0,01 |
| 109.718 US\$ | 142.071.225 KRW | 16.01.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | 107 | 0,00 |
| 67.110 US\$ | 60.349 € | 05.02.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 352 | 0,00 |
| 148.304 US\$ | 192.031.198 KRW | 22.01.2024 | Morgan Stanley | 1 | 79 | 0,00 |
| 2.170.860 UYU | 53.948 US\$ | 09.02.2024 | Citibank NA | 1 | 1.509 | 0,00 |
| 4.305.746 UYU | 107.509 US\$ | 27.03.2024 | Citibank NA | 1 | 1.885 | 0,00 |
| 770.681 UYU | 19.029 US\$ | 09.02.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 659 | 0,00 |
| 2.410.306 UYU | 59.579 US\$ | 09.02.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | 1.994 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> | | | | | | |
| 15.155.801 AUD | 10.006.122 US\$ | 14.03.2024 | BNP Paribas | 1 | 357.967 | 0,55 |

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 3,57 % (31. Dezember 2022: 0,83 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen AUD (Fortsetzung)</i> | | | | | | |
| 631.829 AUD | 418.971 US\$ | 14.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 3 | 13.097 | 0,02 |
| <i>Abgesicherte Klassen NOK</i> | | | | | | |
| 2.918.020 NOK | 269.273 US\$ | 14.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 18.523 | 0,03 |
| 258.400.586 NOK | 23.681.056 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 8 | 1.804.241 | 2,77 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | 2.325.031 | 3,57 |

Futures-Kontrakte 1,28 % (31. Dezember 2022: 1,12 %)

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens | |
|--|---|--------------------------------|----------------------|-------------|
| 21 | Euro-BOBL Future March 2024 | 59.434 | 0,09 | |
| 1 | Euro-Schatz Future March 2024 | 502 | 0,00 | |
| 1 | South Korea 10-Year Bond Future March 2024 | 1.188 | 0,00 | |
| 9 | South Korea 3-Year Bond Future March 2024 | 2.236 | 0,00 | |
| 9 | US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2024 | 20.320 | 0,03 | |
| 32 | US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2024 | 81.828 | 0,13 | |
| 30 | US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2024 | 292.094 | 0,45 | |
| 29 | US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2024 | 374.508 | 0,58 | |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten [*] | | | 832.110 | 1,28 |

Zinsswap-Kontrakte 0,03 % (31. Dezember 2022: 0,08 %)

| Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei | Erhalt/(Zahlung) [#] | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|------------|--|-------------------------------|-----------------|--------------------|--------------------------------|----------------------|
| MXN 2.313.879 | 30.10.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 9,26 % | 28D MXIBTIIE | 3.663 | 0,01 |
| CZK 1.892.163 | 25.07.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 4,19 % | 6M PRIBOR | 2.093 | 0,01 |
| COP 193.997.409 | 06.01.2027 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | Erhalt | 6,40 % | 1D COOVIBR | 1.955 | 0,01 |
| COP 711.742.190 | 13.04.2024 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | Erhalt | 8,37 % | 1D COOVIBR | 1.899 | 0,00 |
| MXN 2.318.249 | 17.08.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 8,94 % | 28D MXIBTIIE | 1.686 | 0,00 |
| MXN 6.749.247 | 25.03.2026 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 9,33 % | 28D MXIBTIIE | 1.603 | 0,00 |
| MXN 2.318.248 | 17.08.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 8,91 % | 28D MXIBTIIE | 1.529 | 0,00 |
| CZK 17.495.416 | 22.12.2025 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 4,47 % | 6M PRIBOR | 1.510 | 0,00 |
| COP 125.606.377 | 07.01.2027 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | Erhalt | 6,45 % | 1D COOVIBR | 1.219 | 0,00 |
| CLP 6.474.990 | 05.06.2030 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | Erhalt | 2,33 % | 1D CLICP | 997 | 0,00 |
| COP 186.628.026 | 31.01.2027 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | Erhalt | 7,14 % | 1D COOVIBR | 927 | 0,00 |
| MYR 1.339.938 | 20.12.2025 | Goldman Sachs International | (Zahlung) | 3,50 % | 3M KLIBOR | 57 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten [∞] | | | | | | 19.138 | 0,03 |

[#]Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

¹Zentral abgewickelter Swap.

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|--|-------------------|------------------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 61.503.601 | 94,52 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,43 %) (31. Dezember 2022: (0,63 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 81.403.218 CLP | 92.902 US\$ | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | (60) | (0,00) |
| 15.197.208 € | 16.794.890 US\$ | 03.01.2024 | Citibank NA | 1 | (7.293) | (0,01) |
| 147.872 € | 737.555 RON | 19.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (284) | (0,00) |
| 36.010.214 HUF | 93.973 € | 06.02.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (389) | (0,00) |
| 192.031.198 KRW | 149.087 US\$ | 22.01.2024 | Citibank NA | 1 | (862) | (0,00) |
| 440.899 PLN | 101.156 € | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | (87) | (0,00) |
| 1.834.523 PLN | 421.207 € | 20.03.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | (707) | (0,00) |
| 145.168 RON | 29.158 € | 19.01.2024 | Barclays Bank Plc | 1 | (3) | (0,00) |
| 671.145 US\$ | 615.451 € | 04.01.2024 | Barclays Bank Plc | 3 | (8.739) | (0,01) |
| 187.703 US\$ | 170.941 € | 05.02.2024 | Citibank NA | 2 | (1.392) | (0,00) |
| 110.691 US\$ | 3.857.768 THB | 16.01.2024 | Citibank NA | 1 | (2.464) | (0,01) |
| 68.127 US\$ | 1.198.823 MXN | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | (1.776) | (0,00) |
| 7.384 US\$ | 9.639.523 KRW | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | (84) | (0,00) |
| 298.358 US\$ | 272.037 € | 17.01.2024 | Citibank NA | 1 | (2.321) | (0,00) |
| 88.486 US\$ | 340.033 PEN | 18.01.2024 | Citibank NA | 1 | (3.306) | (0,01) |
| 103.507 US\$ | 141.064 SGD | 22.01.2024 | Citibank NA | 1 | (3.532) | (0,01) |
| 108.041 US\$ | 99.611 € | 04.01.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | (1.998) | (0,00) |
| 22.048 US\$ | 340.843.800 IDR | 07.02.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | (60) | (0,00) |
| 196.821 US\$ | 802.263.729 COP | 20.03.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (7.071) | (0,01) |
| 436.389 US\$ | 1.769.639.501 COP | 01.02.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (17.468) | (0,03) |
| 148.912 US\$ | 5.224.125 THB | 22.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (4.415) | (0,01) |
| 216.818 US\$ | 200.597 € | 04.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (4.780) | (0,01) |
| 32.879 US\$ | 152.512 MYR | 20.03.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | (564) | (0,00) |
| 89.582 US\$ | 1.389.183.027 IDR | 20.03.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | (501) | (0,00) |
| 128.928 US\$ | 5.248.021 UYU | 09.02.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | (5.138) | (0,01) |
| 10.042 US\$ | 13.106.039 KRW | 20.03.2024 | HSBC Bank Plc | 2 | (112) | (0,00) |
| 31.510 US\$ | 1.103.899 THB | 20.03.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | (1.049) | (0,00) |
| 108.862 US\$ | 3.379.606 TWD | 08.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (1.780) | (0,00) |
| 43.575 US\$ | 201.950 MYR | 20.03.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (708) | (0,00) |
| 34.047 US\$ | 527.248.109 IDR | 20.03.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (143) | (0,00) |
| 102.553 US\$ | 485.792 MYR | 23.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (3.510) | (0,01) |
| 27.457 US\$ | 110.436.667 COP | 20.03.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (610) | (0,00) |

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (0,43 %) (31. Dezember 2022: (0,63 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 151.122 US\$ | 139.454 € | 04.01.2024 | Morgan Stanley | 1 | (2.931) | (0,01) |
| 208.985 US\$ | 782.543 PEN | 18.01.2024 | Morgan Stanley | 1 | (2.262) | (0,00) |
| 124.104 US\$ | 1.942.270.600 IDR | 20.03.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | (1.844) | (0,00) |
| 16.491.153 US\$ | 15.071.364 € | 03.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | (157.432) | (0,24) |
| 359.112 US\$ | 327.000 € | 03.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | (2.109) | (0,00) |
| 218.204 US\$ | 6.982.751 TWD | 12.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | (10.912) | (0,02) |
| <i>Abgesicherte Klassen NOK</i> | | | | | | |
| 7.992 NOK | 790 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (1) | (0,00) |
| 364.691 US\$ | 3.936.357 NOK | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | (23.541) | (0,03) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | (284.238) | (0,43) |

Futures-Kontrakte (0,55 %) (31. Dezember 2022: (0,12 %))

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|--|---------------------------------|-------------------------|
| (25) | Euro-BOBL Future March 2024 | (43.357) | (0,07) |
| (63) | Euro-Bund Future March 2024 | (234.628) | (0,36) |
| (8) | Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2024 | (78.916) | (0,12) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten [*] | | | (356.901) (0,55) |

Zinsswap-Kontrakte (0,06 %) (31. Dezember 2022: (0,25 %))

| Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei | Erhalt/(Zahlung) [#] | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|------------|--|-------------------------------|-----------------|--------------------|---------------------------------|----------------------|
| INR 21.347.652 | 19.12.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 6,21 % | 1D MIBOR | (7) | (0,00) |
| CLP 130.694.684 | 24.10.2033 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 6,12 % | 1D CLICP | (16) | (0,00) |
| PLN 535.134 | 07.11.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 4,51 % | 6M WIBOR | (617) | (0,00) |
| CLP 17.013.289 | 09.11.2025 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | (Zahlung) | 1,24 % | 1D CLICP | (1.396) | (0,00) |
| PLN 417.496 | 10.10.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 4,76 % | 6M WIBOR | (1.565) | (0,00) |
| PLN 534.271 | 01.12.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 4,72 % | 6M WIBOR | (1.750) | (0,00) |
| CLP 94.826.734 | 13.04.2025 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | Erhalt | 7,51 % | 1D CLICP | (2.353) | (0,00) |
| COP 129.448.750 | 11.08.2032 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | Erhalt | 9,02 % | 1D COOVIBR | (2.903) | (0,01) |
| PLN 294.489 | 02.10.2033 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 4,99 % | 6M WIBOR | (2.968) | (0,01) |
| PLN 431.789 | 03.10.2033 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 5,01 % | 6M WIBOR | (4.525) | (0,01) |
| COP 1.721.774.842 | 07.06.2025 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | Erhalt | 10,29 % | 1D COOVIBR | (5.324) | (0,01) |
| MXN 2.369.982 | 08.10.2038 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 9,77 % | 28D MXIBTIE | (15.019) | (0,02) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten [∞] | | | | | | (38.443) | (0,06) |

[#]Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

¹Zentral abgewickelter Swap.

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|-------------------|------------------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (679.582) | (1,04) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | 60.824.019 | 93,48 |
| Sonstiges Nettovermögen | 4.243.530 | 6,52 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | 65.067.549 | 100,00 |

| Portfolioanalyse | US\$ | % des Gesamtver- mögens |
|---|-------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 51.464.560 | 78,12 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 6.665.974 | 10,12 |
| † Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente | 196.788 | 0,30 |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 475.209 | 0,72 |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap | 2.021.488 | 3,07 |
| Anlagen insgesamt | 60.824.019 | 92,33 |

Emerging Markets Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|--|--|-------------------|------------------------------|
| Aktien 96,27 % (31. Dezember 2022: 98,40 %) | | | |
| Brasilianischer Real | | | |
| 247.975 | B3 SA - Brasil Bolsa Balcao* | 741.934 | 0,82 |
| 96.014 | Banco BTG Pactual SA* | 742.623 | 0,82 |
| 101.318 | Banco do Brasil SA* | 1.154.968 | 1,27 |
| 93.121 | Embraer SA* | 425.836 | 0,47 |
| 122.637 | Equatorial Energia SA* | 902.158 | 0,99 |
| 121.315 | Petroleo Brasileiro SA - Preferred Shares* | 925.610 | 1,02 |
| Brasilianischer Real insgesamt | | 4.893.129 | 5,39 |
| Kanadischer Dollar | | | |
| 27.871 | Parex Resources Inc** | 527.363 | 0,58 |
| Kanadischer Dollar insgesamt | | 527.363 | 0,58 |
| Chinesischer Yuan Renminbi | | | |
| 203.300 | Foxconn Industrial Internet Co Ltd Class A* | 431.691 | 0,48 |
| 4.386 | Kweichow Moutai Co Ltd Class A* | 1.063.146 | 1,17 |
| 269.704 | NARI Technology Co Ltd Class A* | 845.405 | 0,93 |
| 41.500 | Proya Cosmetics Co Ltd Class A* | 579.319 | 0,64 |
| 94.600 | Shenzhen Inovance Technology Co Ltd Class A* | 838.840 | 0,93 |
| 21.600 | Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd Class A* | 881.521 | 0,97 |
| Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt | | 4.639.922 | 5,12 |
| Hongkong-Dollar | | | |
| 44.400 | AIA Group Ltd* | 386.937 | 0,43 |
| 258.624 | Alibaba Group Holding Ltd* | 2.503.919 | 2,76 |
| 2.899.000 | China Construction Bank Corp - H Shares* | 1.726.358 | 1,90 |
| 22.100 | Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd* | 758.502 | 0,84 |
| 108.900 | Tencent Holdings Ltd* | 4.094.619 | 4,51 |
| 71.000 | Tsingtao Brewery Co Ltd - H Shares* | 476.452 | 0,53 |
| 36.100 | WuXi AppTec Co Ltd - H Shares* | 367.308 | 0,40 |
| Hongkong-Dollar insgesamt | | 10.314.095 | 11,37 |
| Ungarischer Forint | | | |
| 15.375 | OTP Bank Nyrt* | 702.084 | 0,78 |
| 33.465 | Richter Gedeon Nyrt* | 846.284 | 0,93 |
| Ungarischer Forint insgesamt | | 1.548.368 | 1,71 |
| Indische Rupie | | | |
| 16.367 | Apollo Hospitals Enterprise Ltd* | 1.122.685 | 1,24 |
| 186.989 | Aptus Value Housing Finance India Ltd* | 718.957 | 0,79 |
| 122.450 | ASK Automotive Ltd* | 425.414 | 0,47 |
| 135.733 | ASK Automotive Ltd 2* | 464.841 | 0,51 |

Emerging Markets Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---|-------------------|----------------------|
| Aktien 96,27 % (31. Dezember 2022: 98,40 %) (Fortsetzung) | | | |
| Indische Rupie (Fortsetzung) | | | |
| 6.596 | Bajaj Finance Ltd* | 579.433 | 0,64 |
| 3.711 | Best Agrolife Ltd* | 37.501 | 0,04 |
| 503.968 | Bharat Electronics Ltd* | 1.111.332 | 1,23 |
| 34.899 | Bharti Airtel Ltd* | 431.972 | 0,48 |
| 63.678 | Cholamandalam Investment & Finance Co Ltd* | 962.665 | 1,06 |
| 19.557 | GMM Pfaudler Ltd* | 378.384 | 0,42 |
| 45.921 | HDFC Bank Ltd* | 942.549 | 1,04 |
| 9.420 | Hero MotoCorp Ltd* | 469.337 | 0,52 |
| 74.149 | ICICI Bank Ltd* | 889.641 | 0,98 |
| 71.155 | IndusInd Bank Ltd* | 1.364.634 | 1,50 |
| 44.074 | JB Chemicals & Pharmaceuticals Ltd* | 857.950 | 0,95 |
| 15.350 | Kaynes Technology India Ltd* | 481.637 | 0,53 |
| 21.968 | Larsen & Toubro Ltd* | 929.262 | 1,02 |
| 32.731 | Rainbow Children's Medicare Ltd* | 468.070 | 0,52 |
| 36.038 | Reliance Industries Ltd* | 1.120.371 | 1,23 |
| 45.079 | Sun Pharmaceutical Industries Ltd* | 683.089 | 0,75 |
| 91.727 | Syrma SGS Technology Ltd* | 735.789 | 0,81 |
| 114.966 | Texmaco Rail & Engineering Ltd* | 235.559 | 0,26 |
| 12.158 | Tube Investments of India Ltd* | 517.214 | 0,57 |
| 25.071 | Venus Pipes & Tubes Ltd* | 422.401 | 0,47 |
| 6.754 | Voltamp Transformers Ltd* | 529.030 | 0,58 |
| | Indische Rupie insgesamt | 16.879.717 | 18,61 |
| Indonesische Rupiah | | | |
| 875.100 | Bank Central Asia Tbk PT* | 534.256 | 0,59 |
| 3.047.100 | Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT* | 1.063.724 | 1,17 |
| | Indonesische Rupiah insgesamt | 1.597.980 | 1,76 |
| Mexikanischer Peso | | | |
| 139.571 | Grupo Financiero Banorte SAB de CV Class O* | 1.410.174 | 1,56 |
| 247.598 | Wal-Mart de Mexico SAB de CV* | 1.043.788 | 1,15 |
| | Mexikanischer Peso insgesamt | 2.453.962 | 2,71 |
| Neuer taiwanesischer Dollar | | | |
| 49.200 | Accton Technology Corp* | 838.422 | 0,93 |
| 110.000 | Chroma ATE Inc* | 763.428 | 0,84 |
| 265.000 | Far EasTone Telecommunications Co Ltd* | 689.041 | 0,76 |
| 7.000 | Global Unichip Corp* | 396.866 | 0,44 |
| 119.425 | Hiwin Technologies Corp* | 914.448 | 1,01 |
| 21.000 | Jentech Precision Industrial Co Ltd* | 526.189 | 0,58 |

Emerging Markets Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---------------------------------|-------------------|------------------------------|
| Aktien 96,27 % (31. Dezember 2022: 98,40 %) (Fortsetzung) | | | |
| Neuer taiwanesischer Dollar (Fortsetzung) | | | |
| 42.000 | MediaTek Inc* | 1.389.029 | 1,53 |
| 434.000 | Uni-President Enterprises Corp* | 1.053.518 | 1,16 |
| Neuer taiwanesischer Dollar insgesamt | | 6.570.941 | 7,25 |
| Philippinischer Peso | | | |
| 385.320 | BDO Unibank Inc* | 908.068 | 1,00 |
| 46.580 | SM Investments Corp* | 733.503 | 0,81 |
| Philippinischer Peso insgesamt | | 1.641.571 | 1,81 |
| Polnischer Zloty | | | |
| 8.423 | Dino Polska SA* | 986.834 | 1,09 |
| Polnischer Zloty insgesamt | | 986.834 | 1,09 |
| Britisches Pfund | | | |
| 36.808 | Antofagasta Plc* | 788.069 | 0,87 |
| 20.674 | Rio Tinto Plc* | 1.539.672 | 1,70 |
| Britisches Pfund insgesamt | | 2.327.741 | 2,57 |
| Saudi-Arabischer Riyal | | | |
| 103.029 | Ades Holding Co* | 662.683 | 0,73 |
| 40.475 | Al Rajhi Bank* | 938.454 | 1,04 |
| 22.653 | Al-Dawaa Medical Services Co* | 637.476 | 0,70 |
| 66.150 | Alinma Bank* | 683.081 | 0,75 |
| 99.091 | Saudi Arabian Oil Co* | 872.412 | 0,96 |
| Saudi-Arabischer Riyal insgesamt | | 3.794.106 | 4,18 |
| Südafrikanischer Rand | | | |
| 46.931 | Bid Corp Ltd* | 1.094.907 | 1,21 |
| Südafrikanischer Rand insgesamt | | 1.094.907 | 1,21 |
| Südkoreanischer Won | | | |
| 1.181 | LG Chem Ltd* | 454.240 | 0,50 |
| 6.714 | Orion Corp* | 602.515 | 0,67 |
| 102.347 | Samsung Electronics Co Ltd* | 6.212.140 | 6,85 |
| 31.604 | Samsung Engineering Co Ltd* | 707.970 | 0,78 |
| 22.433 | SK Hynix Inc* | 2.448.292 | 2,70 |
| Südkoreanischer Won insgesamt | | 10.425.157 | 11,50 |

Emerging Markets Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|--|-------------------|----------------------|
| Aktien 96,27 % (31. Dezember 2022: 98,40 %) (Fortsetzung) | | | |
| Thailändischer Baht | | | |
| 184.700 | Bangkok Bank PCL* | 846.746 | 0,93 |
| Thailändischer Baht insgesamt | | 846.746 | 0,93 |
| VAE-Dirham | | | |
| 776.629 | Adnoc Gas Plc* | 653.403 | 0,72 |
| 557.803 | Dubai Islamic Bank PJSC* | 868.731 | 0,96 |
| Gesamt VAE-Dirham | | 1.522.134 | 1,68 |
| US-Dollar | | | |
| 7.675 | Baidu Inc ADR* | 914.016 | 1,01 |
| 5.295 | Credicorp Ltd* | 793.879 | 0,87 |
| 3.724 | Globant SA* | 886.237 | 0,98 |
| 41.431 | KE Holdings Inc ADR* | 671.596 | 0,74 |
| 12.880 | Las Vegas Sands Corp* | 633.825 | 0,70 |
| 7.517 | NetEase Inc ADR* | 700.284 | 0,77 |
| 2.595 | NVIDIA Corp* | 1.285.096 | 1,42 |
| 11.357 | PDD Holdings Inc ADR* | 1.661.643 | 1,83 |
| 64.996 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR* | 6.759.584 | 7,45 |
| 25.878 | Trip.com Group Ltd ADR* | 931.867 | 1,03 |
| US-Dollar insgesamt | | 15.238.027 | 16,80 |
| Aktien insgesamt | | 87.302.700 | 96,27 |
| Immobilienaktiengesellschaften 0,53 % (31. Dezember 2022: 0,00 %) | | | |
| Mexikanischer Peso | | | |
| 244.957 | FIBRA Macquarie Mexico | 481.105 | 0,53 |
| Immobilienaktiengesellschaften insgesamt * | | 481.105 | 0,53 |
| Anlagen insgesamt | | 87.783.805 | 96,80 |

Emerging Markets Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 1,40 % (31. Dezember 2022: 0,55 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|-----------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> | | | | | | |
| 223.365 AUD | 146.649 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 11 | 5.843 | 0,01 |
| 8.137.658 AUD | 5.239.690 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 40 | 315.933 | 0,35 |
| <i>Abgesicherte Klassen CAD</i> | | | | | | |
| 1.379.326 CAD | 1.018.434 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 11 | 27.859 | 0,03 |
| 538.802 CAD | 396.891 US\$ | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 4 | 11.819 | 0,01 |
| 11.239.614 CAD | 8.287.320 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 5 | 238.520 | 0,26 |
| 11.107.692 CAD | 8.184.525 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | 241.245 | 0,27 |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 50.583 € | 55.326 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | 586 | 0,00 |
| 2.748.383 € | 2.929.475 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 10 | 108.416 | 0,12 |
| 2.695.517 € | 2.871.424 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 12 | 108.032 | 0,12 |
| 11 US\$ | 10 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 0 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 20.766 £ | 25.626 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | 849 | 0,00 |
| 472.939 £ | 581.218 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 8 | 21.738 | 0,02 |
| 58.917 £ | 73.159 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 13 | 1.954 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i> | | | | | | |
| 68.578.969 ZAR | 3.559.525 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 11 | 185.519 | 0,21 |
| 1.192.823 ZAR | 63.373 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 3 | 1.766 | 0,00 |
| 2.097.994 ZAR | 112.238 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 53 | 2.330 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ^o | | | | | 1.272.409 | 1,40 |
| | | | | | Zeitwert US\$ | % des #Nettvermögens |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | | | | | 89.056.214 | 98,20 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,87 %) (31. Dezember 2022: (0,35 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> | | | | | | |
| 20.307 AUD | 13.884 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (21) | (0,00) |
| 17.064 AUD | 11.683 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 4 | (33) | (0,00) |
| 57.592 US\$ | 89.872 AUD | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 6 | (3.763) | (0,01) |
| 40.789 US\$ | 62.545 AUD | 18.01.2024 | UBS AG | 4 | (1.912) | (0,00) |
| 3.948.597 US\$ | 6.133.856 AUD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 18 | (239.019) | (0,27) |
| <i>Abgesicherte Klassen CAD</i> | | | | | | |
| 394.597 US\$ | 536.940 CAD | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 6 | (12.701) | (0,02) |
| 529.804 US\$ | 725.662 CAD | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 8 | (20.649) | (0,02) |

Emerging Markets Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (0,87 %) (31. Dezember 2022: (0,35 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen CAD (Fortsetzung)</i> | | | | | | |
| 44.727 US\$ | 61.128 CAD | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (1.642) | (0,00) |
| 8.104.827 US\$ | 10.998.521 CAD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | (238.131) | (0,26) |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 22.123 € | 24.494 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | (41) | (0,00) |
| 64.142 US\$ | 59.456 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 5 | (1.577) | (0,00) |
| 2.024.610 US\$ | 1.899.671 € | 18.01.2024 | UBS AG | 3 | (75.168) | (0,08) |
| 2.408.375 US\$ | 2.261.664 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 13 | (91.527) | (0,10) |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 2.464 £ | 3.152 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (10) | (0,00) |
| 4.817 £ | 6.143 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (1) | (0,00) |
| 11.775 US\$ | 9.597 £ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | (460) | (0,00) |
| 16.331 US\$ | 13.169 £ | 18.01.2024 | UBS AG | 3 | (459) | (0,00) |
| 51.936 US\$ | 41.960 £ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 10 | (1.560) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i> | | | | | | |
| 1.777.609 US\$ | 34.240.014 ZAR | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 12 | (92.211) | (0,10) |
| 11.656 US\$ | 223.045 ZAR | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (524) | (0,00) |
| 279.663 US\$ | 5.225.452 ZAR | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 28 | (5.696) | (0,01) |
| 718.562 ZAR | 39.286 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (46) | (0,00) |
| 24.500 ZAR | 1.339 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | (1) | (0,00) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | (787.152) | (0,87) |

| | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|---|-------------------|----------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (787.152) | (0,87) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | 88.269.062 | 97,33 |
| Sonstiges Nettovermögen | 2.418.439 | 2,67 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | 90.687.501 | 100,00 |

| Portfolioanalyse | US\$ | % des Gesamtvermögens |
|---|-------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 87.256.442 | 94,18 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 527.363 | 0,57 |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente | 485.257 | 0,52 |
| Anlagen insgesamt | 88.269.062 | 95,27 |

Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert EUR | % des Netto- vermögens |
|---|--|--------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 0,04 % (31. Dezember 2022: 4,98 %) | | | | | |
| Euro | | | | | |
| 4.284 | Gedesco Trade Receivables 2020-1 DAC Class A | 5,03 % | 24.01.2026 | 4.100 | 0,04 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt ** | | | | 4.100 | 0,04 |
| Unternehmensanleihen 45,11 % (31. Dezember 2022: 43,88 %) | | | | | |
| Euro | | | | | |
| 100.000 | AMCO - Asset Management Co SpA* | 0,75 % | 20.04.2028 | 87.958 | 0,83 |
| 110.000 | AMCO - Asset Management Co SpA* | 4,63 % | 06.02.2027 | 113.044 | 1,07 |
| 100.000 | Aroundtown SA* | 0,38 % | 15.04.2027 | 80.695 | 0,76 |
| 100.000 | Athene Global Funding* | 0,83 % | 08.01.2027 | 92.362 | 0,87 |
| 100.000 | AusNet Services Holdings Pty Ltd* | 1,63 % | 11.03.2081 | 90.478 | 0,86 |
| 100.000 | Bank of New Zealand* | 2,55 % | 29.06.2027 | 98.515 | 0,93 |
| 90.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA* | 3,21 % | 29.12.2049 | 75.708 | 0,72 |
| 100.000 | Bayerische Landesbank* | 7,00 % | 05.01.2034 | 103.766 | 0,98 |
| 100.000 | BCP V Modular Services Finance II Plc** | 4,75 % | 30.11.2028 | 93.162 | 0,88 |
| 100.000 | BNP Paribas Fortis SA* | 3,75 % | 30.10.2028 | 104.338 | 0,99 |
| 100.000 | BPCE SFH SA* | 3,13 % | 24.01.2028 | 101.394 | 0,96 |
| 100.000 | Caisse de Refinancement de l'Habitat SA* | 3,00 % | 11.01.2030 | 101.185 | 0,96 |
| 100.000 | Canadian Imperial Bank of Commerce* | 3,25 % | 31.03.2027 | 100.938 | 0,95 |
| 100.000 | Carmila SA* | 5,50 % | 09.10.2028 | 103.816 | 0,98 |
| 100.000 | Cie de Financement Foncier SA* | 2,00 % | 07.05.2024 | 99.370 | 0,94 |
| 100.000 | Cirsa Finance International Sarl* | 4,50 % | 15.03.2027 | 96.531 | 0,91 |
| 100.000 | Commerzbank AG* | 6,75 % | 05.10.2033 | 106.700 | 1,01 |
| 100.000 | Commonwealth Bank of Australia* | 0,75 % | 28.02.2028 | 91.719 | 0,87 |
| 100.000 | Commonwealth Bank of Australia* | 3,25 % | 24.10.2025 | 100.284 | 0,95 |
| 100.000 | CPI Property Group SA* | 2,75 % | 12.05.2026 | 83.735 | 0,79 |
| 100.000 | Credit Agricole Home Loan SFH SA* | 0,13 % | 16.12.2024 | 96.975 | 0,92 |
| 100.000 | Credit Agricole Home Loan SFH SA* | 3,13 % | 18.10.2030 | 101.774 | 0,96 |
| 100.000 | Cullinan Holdco Scsp** | 4,63 % | 15.10.2026 | 78.170 | 0,74 |
| 100.000 | Dexia Credit Local SA* | 0,63 % | 17.01.2026 | 95.783 | 0,91 |
| 100.000 | Digital Intrepid Holding BV* | 1,38 % | 18.07.2032 | 81.651 | 0,77 |
| 100.000 | EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG* | 1,38 % | 31.08.2081 | 85.583 | 0,81 |
| 100.000 | Fastighets AB Balder* | 1,88 % | 23.01.2026 | 91.352 | 0,86 |
| 100.000 | Federation des Caisses Desjardins du Quebec* | 2,88 % | 28.11.2024 | 99.383 | 0,94 |
| 100.000 | Global Payments Inc* | 4,88 % | 17.03.2031 | 105.239 | 0,99 |
| 100.000 | Grand City Properties SA* | 5,90 % | 29.12.2049 | 57.362 | 0,54 |
| 100.000 | Heimstaden Bostad AB* | 3,38 % | 29.12.2049 | 42.464 | 0,40 |
| 100.000 | Iceland Bondco Plc** | 9,50 % | 15.12.2027 | 100.200 | 0,95 |
| 100.000 | Imerys SA* | 4,75 % | 29.11.2029 | 101.772 | 0,96 |
| 100.000 | Kleopatra Holdings 2 SCA* | 6,50 % | 01.09.2026 | 54.079 | 0,51 |

Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert EUR | % des Nettöver- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 45,11 % (31. Dezember 2022: 43,88 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Euro (Fortsetzung) | | | | | |
| 55.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau* | 0,00 % | 15.09.2031 | 45.574 | 0,43 |
| 100.000 | Loxam SAS* | 6,38 % | 15.05.2028 | 104.390 | 0,99 |
| 100.000 | Loxam SAS* | 6,38 % | 31.05.2029 | 103.847 | 0,98 |
| 100.000 | Maxeda DIY Holding BV** | 5,88 % | 01.10.2026 | 76.463 | 0,72 |
| 100.000 | National Australia Bank Ltd* | 2,35 % | 30.08.2029 | 96.811 | 0,92 |
| 100.000 | National Grid North America Inc* | 4,67 % | 12.09.2033 | 106.939 | 1,01 |
| 100.000 | Pinnacle Bidco Plc* | 8,25 % | 11.10.2028 | 104.254 | 0,99 |
| 100.000 | Sogecap SA* | 6,50 % | 16.05.2044 | 108.177 | 1,02 |
| 130.000 | Southern Co* | 1,88 % | 15.09.2081 | 111.817 | 1,06 |
| 100.000 | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd* | 4,09 % | 19.04.2028 | 103.685 | 0,98 |
| 100.000 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV* | 7,38 % | 15.09.2029 | 109.699 | 1,04 |
| 100.000 | Thames Water Utilities Finance Plc* | 4,38 % | 18.01.2031 | 94.808 | 0,90 |
| 100.000 | Traton Finance Luxembourg SA* | 4,50 % | 23.11.2026 | 102.216 | 0,97 |
| 100.000 | UBS Group AG* | 2,13 % | 13.10.2026 | 97.239 | 0,92 |
| 100.000 | Unibail-Rodamco-Westfield SE* | 7,25 % | 29.12.2049 | 100.365 | 0,95 |
| 100.000 | Volkswagen International Finance NV* | 3,88 % | 29.12.2049 | 91.933 | 0,87 |
| 100.000 | Westpac Banking Corp* | 0,38 % | 02.04.2026 | 94.369 | 0,89 |
| Unternehmensanleihen insgesamt | | | | 4.770.071 | 45,11 |
| Staatsanleihen 51,07 % (31. Dezember 2022: 43,09 %) | | | | | |
| Euro | | | | | |
| 100.000 | Acquirente Unico SpA* | 2,80 % | 20.02.2026 | 98.254 | 0,93 |
| 75.000 | Autonomous Community of Madrid Spain* | 2,08 % | 12.03.2030 | 71.540 | 0,68 |
| 100.000 | Bank Gospodarstwa Krajowego* | 3,00 % | 30.05.2029 | 97.763 | 0,92 |
| 100.000 | Bank Gospodarstwa Krajowego* | 4,00 % | 08.09.2027 | 101.992 | 0,96 |
| 52.000 | Bulgaria Government International Bond* | 4,88 % | 13.05.2036 | 55.781 | 0,53 |
| 55.600 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe* | 0,00 % | 15.08.2030 | 49.206 | 0,47 |
| 92.163 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe* | 1,25 % | 15.08.2048 | 74.909 | 0,71 |
| 134.071 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe* | 1,70 % | 15.08.2032 | 131.322 | 1,24 |
| 52.000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe* | 4,75 % | 04.07.2034 | 65.105 | 0,62 |
| 100.000 | Caisse Francaise de Financement Local* | 3,50 % | 20.03.2029 | 103.567 | 0,98 |
| 20.000 | European Financial Stability Facility* | 2,88 % | 16.02.2033 | 20.425 | 0,19 |
| 83.000 | European Financial Stability Facility* | 3,50 % | 11.04.2029 | 87.134 | 0,82 |
| 90.000 | European Stability Mechanism* | 1,00 % | 23.06.2027 | 85.752 | 0,81 |
| 50.000 | European Stability Mechanism* | 3,00 % | 23.08.2033 | 51.706 | 0,49 |
| 111.000 | European Union* | 2,00 % | 04.10.2027 | 109.374 | 1,03 |
| 220.000 | European Union* | 3,25 % | 04.07.2034 | 230.754 | 2,18 |
| 99.000 | European Union* | 3,38 % | 04.10.2038 | 104.070 | 0,98 |
| 95.000 | European Union* | 1,63 % | 04.12.2029 | 90.691 | 0,86 |

Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert EUR | % des Nettöver- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 51,07 % (31. Dezember 2022: 43,09 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Euro (Fortsetzung) | | | | | |
| 69.000 | European Union* | 2,75 % | 04.12.2037 | 67.775 | 0,64 |
| 25.555 | French Republic Government Bond OAT* | 0,75 % | 25.05.2052 | 14.679 | 0,14 |
| 180.381 | French Republic Government Bond OAT* | 1,25 % | 25.05.2038 | 147.045 | 1,39 |
| 63.491 | French Republic Government Bond OAT* | 1,50 % | 25.05.2031 | 59.986 | 0,57 |
| 54.000 | French Republic Government Bond OAT* | 1,50 % | 25.05.2050 | 39.292 | 0,37 |
| 12.650 | French Republic Government Bond OAT* | 1,75 % | 25.05.2066 | 9.066 | 0,09 |
| 125.000 | Hellenic Republic Government Bond* | 4,38 % | 18.07.2038 | 137.835 | 1,30 |
| 55.000 | Instituto de Credito Oficial* | 3,80 % | 31.05.2029 | 57.810 | 0,55 |
| 21.000 | Ireland Government Bond* | 0,55 % | 22.04.2041 | 14.756 | 0,14 |
| 20.800 | Ireland Government Bond* | 3,00 % | 18.10.2043 | 21.652 | 0,21 |
| 55.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | 0,00 % | 01.08.2026 | 51.244 | 0,49 |
| 46.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro* | 0,25 % | 15.03.2028 | 41.246 | 0,39 |
| 85.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | 1,20 % | 15.08.2025 | 82.658 | 0,78 |
| 48.973 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | 1,40 % | 26.05.2025 | 48.200 | 0,46 |
| 60.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro* | 1,45 % | 01.03.2036 | 46.225 | 0,44 |
| 136.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | 1,60 % | 01.06.2026 | 132.299 | 1,25 |
| 169.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | 1,75 % | 30.05.2024 | 167.608 | 1,59 |
| 100.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro* | 1,85 % | 01.07.2025 | 98.321 | 0,93 |
| 62.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | 2,05 % | 01.08.2027 | 60.403 | 0,57 |
| 44.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | 2,50 % | 01.12.2032 | 40.647 | 0,38 |
| 125.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro* | 3,00 % | 01.08.2029 | 124.582 | 1,18 |
| 143.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro* | 3,40 % | 28.03.2025 | 143.395 | 1,36 |
| 56.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro* | 4,00 % | 01.02.2037 | 56.716 | 0,54 |
| 51.000 | Kingdom of Belgium Government Bond* | 0,35 % | 22.06.2032 | 42.671 | 0,40 |
| 28.904 | Kingdom of Belgium Government Bond* | 0,40 % | 22.06.2040 | 19.287 | 0,18 |
| 77.696 | Kingdom of Belgium Government Bond* | 1,45 % | 22.06.2037 | 65.656 | 0,62 |
| 44.000 | Kingdom of Belgium Government Bond* | 3,00 % | 22.06.2033 | 45.467 | 0,43 |
| 103.000 | Kommunekredit* | 0,88 % | 03.11.2036 | 81.939 | 0,78 |
| 90.000 | Netherlands Government Bond* | 2,50 % | 15.07.2033 | 91.391 | 0,86 |
| 157.000 | Netherlands Government Bond* | 4,00 % | 15.01.2037 | 183.349 | 1,73 |
| 100.000 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT* | 0,30 % | 17.10.2031 | 84.436 | 0,80 |
| 116.000 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT* | 1,65 % | 16.07.2032 | 107.546 | 1,02 |
| 61.500 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT* | 1,95 % | 15.06.2029 | 60.438 | 0,57 |
| 90.000 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT* | 3,50 % | 18.06.2038 | 94.456 | 0,89 |
| 55.000 | Republic of Austria Government Bond* | 0,90 % | 20.02.2032 | 48.477 | 0,46 |
| 68.000 | Romanian Government International Bond* | 1,75 % | 13.07.2030 | 55.114 | 0,52 |
| 117.000 | Romanian Government International Bond* | 2,12 % | 16.07.2031 | 93.596 | 0,89 |
| 52.000 | Romanian Government International Bond** | 2,88 % | 26.05.2028 | 48.772 | 0,46 |
| 73.000 | Romanian Government International Bond* | 3,62 % | 26.05.2030 | 67.302 | 0,64 |
| 40.000 | Romanian Government International Bond* | 3,88 % | 29.10.2035 | 34.215 | 0,32 |

Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert EUR | % des Nettover- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 51,07 % (31. Dezember 2022: 43,09 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Euro (Fortsetzung) | | | | | |
| 70.000 | Romanian Government International Bond* | 6,38 % | 18.09.2033 | 74.166 | 0,70 |
| 104.000 | Romanian Government International Bond* | 6,63 % | 27.09.2029 | 111.430 | 1,05 |
| 84.000 | Slovenia Government Bond* | 1,19 % | 14.03.2029 | 77.902 | 0,74 |
| 49.000 | Slovenia Government Bond* | 1,50 % | 25.03.2035 | 41.472 | 0,39 |
| 46.000 | Slovenia Government Bond* | 3,63 % | 11.03.2033 | 48.714 | 0,46 |
| 123.000 | Spain Government Bond* | 0,85 % | 30.07.2037 | 90.832 | 0,86 |
| 21.000 | Spain Government Bond* | 2,90 % | 31.10.2046 | 19.020 | 0,18 |
| 50.000 | Spain Government Bond* | 3,15 % | 30.04.2033 | 50.894 | 0,48 |
| 276.000 | Spain Government Bond* | 3,55 % | 31.10.2033 | 289.397 | 2,74 |
| 71.000 | Spain Government Bond* | 4,20 % | 31.01.2037 | 78.665 | 0,74 |
| Staatsanleihen insgesamt | | | | 5.399.389 | 51,07 |
| Anlagen insgesamt | | | | 10.173.560 | 96,22 |

Futures-Kontrakte 0,31 % (31. Dezember 2022: 0,45 %)

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Gewinn EUR | % des Netto- vermögens |
|---|--|-------------------------------------|------------------------------|
| 16 | Euro-BOBL Future March 2024 | 20.960 | 0,20 |
| 1 | Euro-BTP Future March 2024 | 3.120 | 0,03 |
| 1 | Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2024 | 7.080 | 0,07 |
| 3 | Euro-Schatz Future March 2024 | 1.140 | 0,01 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten * | | 32.300 | 0,31 |

Inflation-Swap-Kontrakte 0,06 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)

| Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei | Erhalt/(Zahlung)# | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Gewinn EUR | % des Netto- vermögens |
|---|------------|-------------------------------|-------------------|--------------------|--------------------|-------------------------------------|------------------------------|
| EUR 375.000 | 15.11.2033 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 2,32 % | CPTFEMU | 6.642 | 0,06 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten* | | | | | | 6.642 | 0,06 |

#Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

¹Zentral abgewickelter Swap.

Zinsswap-Kontrakte 0,07 % (31. Dezember 2022: 0,02 %)

| Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei | Erhalt/(Zahlung)# | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Gewinn EUR | % des Netto- vermögens |
|---|------------|-------------------------------|-------------------|--------------------|--------------------|-------------------------------------|------------------------------|
| EUR 170.000 | 26.10.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 3,09 % | 1D €STR | 7.001 | 0,07 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten * | | | | | | 7.001 | 0,07 |

#Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

¹Zentral abgewickelter Swap.

Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| | Zeitwert EUR | % des Nettover- mögens |
|--|-------------------|------------------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 10.219.503 | 96,66 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Futures-Kontrakte (0,18 %) (31. Dezember 2022: (0,88 %))

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Verlust EUR | % des Netto- vermögens |
|--|---|--------------------------------------|------------------------------|
| (4) | Euro-Bund Future March 2024 | (11.080) | (0,10) |
| (4) | Euro-OAT Future March 2024 | (6.950) | (0,07) |
| 5 | Euro-BOBL Put Option on Future February 2024, Strike Price EUR 118.00 | (977) | (0,01) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten * | | (19.007) | (0,18) |

Inflation-Swap-Kontrakte (0,03 %) (31. Dezember 2022: (0,00 %))

| Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei | Erhalt/(Zahlung) [#] | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Verlust EUR | % des Netto- vermögens |
|---|------------|-------------------------------|-------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------------|------------------------------|
| EUR 375.000 | 15.11.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 2,21 % | CPTFEMU | (3.665) | (0,03) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Inflation-Swap-Kontrakten[∞] | | | | | | (3.665) | (0,03) |

[#]Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

¹Zentral abgewickelter Swap.

Zinsswap-Kontrakte (0,04 %) (31. Dezember 2022: (0,26 %))

| Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei | Erhalt/(Zahlung) [#] | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Verlust EUR | % des Netto- vermögens |
|--|------------|-------------------------------|-------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------------|------------------------------|
| EUR 200.031 | 30.08.2032 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 2,22 % | 6M EURIBOR | (3.982) | (0,04) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten[∞] | | | | | | (3.982) | (0,04) |

[#]Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

¹Zentral abgewickelter Swap.

Credit-Default-Swap-Kontrakte (0,52 %) (31. Dezember 2022: (0,07 %))

| Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei | Referenzverbindlichkeit | Zeitwert EUR | % des Nettover- mögens |
|--|------------|-----------------------------|---|-----------------|------------------------------|
| EUR 680.000 | 20.12.2028 | ICE Clear U.S. ¹ | Buying default protection on iTRAXX Europe Crossover S40.V1 | (54.486) | (0,52) |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt * | | | | (54.486) | (0,52) |

¹Zentral abgewickelter Swap.

Euro Bond Absolute Return - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| | Zeitwert EUR | % des Nettover- mögens |
|---|-------------------|------------------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (81.140) | (0,77) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | 10.138.363 | 95,89 |
| Sonstiges Nettovermögen | 434.731 | 4,11 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | 10.573.094 | 100,00 |

| Portfolioanalyse | EUR | % des Gesamtver- mögens |
|---|-------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 9.189.634 | 85,80 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 983.926 | 9,18 |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 13.293 | 0,12 |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap | (48.490) | (0,45) |
| Anlagen insgesamt | 10.138.363 | 94,65 |

Euro Bond Absolute Return - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert EUR | % des Netto- vermögens |
|---|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 0,46 % (31. Dezember 2022: 4,78 %) | | | | | |
| Euro | | | | | |
| 135.085 | Futura S.r.l. Series 2019-1 Class A | 6,97 % | 31.07.2044 | 134.607 | 0,39 |
| 25.199 | Gedesco Trade Receivables 2020-1 DAC Class A | 5,03 % | 24.01.2026 | 24.120 | 0,07 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt ** | | | | 158.727 | 0,46 |
| Unternehmensanleihen 54,54 % (31. Dezember 2022: 49,33 %) | | | | | |
| Dänische Krone | | | | | |
| 9.905.796 | Nykredit Realkredit AS [†] | 4,00 % | 01.10.2053 | 1.314.538 | 3,86 |
| Dänische Krone insgesamt | | | | 1.314.538 | 3,86 |
| Euro | | | | | |
| 100.000 | Altice France SA [†] | 3,38 % | 15.01.2028 | 79.638 | 0,23 |
| 100.000 | Altice France SA ^{**} | 4,13 % | 15.01.2029 | 80.222 | 0,24 |
| 250.000 | AMCO - Asset Management Co SpA [†] | 0,75 % | 20.04.2028 | 219.895 | 0,65 |
| 150.000 | AMCO - Asset Management Co SpA [†] | 4,63 % | 06.02.2027 | 154.151 | 0,45 |
| 100.000 | ANZ New Zealand Int'l Ltd [†] | 3,95 % | 17.07.2026 | 102.387 | 0,30 |
| 200.000 | Arkema SA [†] | 1,50 % | 29.12.2049 | 185.815 | 0,55 |
| 300.000 | Aroundtown SA [†] | 0,38 % | 15.04.2027 | 242.085 | 0,71 |
| 200.000 | Aroundtown SA [†] | 1,63 % | 31.01.2028 | 162.688 | 0,48 |
| 200.000 | Aroundtown SA [†] | 3,38 % | 29.12.2049 | 84.304 | 0,25 |
| 300.000 | Athene Global Funding [†] | 0,83 % | 08.01.2027 | 277.084 | 0,81 |
| 200.000 | AusNet Services Holdings Pty Ltd [†] | 1,63 % | 11.03.2081 | 180.957 | 0,53 |
| 200.000 | Banco de Credito Social Cooperativo SA [†] | 7,50 % | 14.09.2029 | 210.185 | 0,62 |
| 100.000 | Banjay Entertainment SASU ^{**} | 7,00 % | 01.05.2029 | 105.754 | 0,31 |
| 400.000 | Bank of New Zealand [†] | 2,55 % | 29.06.2027 | 394.060 | 1,16 |
| 200.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA [†] | 3,21 % | 29.12.2049 | 168.240 | 0,49 |
| 300.000 | Bayerische Landesbank [†] | 7,00 % | 05.01.2034 | 311.299 | 0,91 |
| 100.000 | BPCE SFH SA [†] | 3,13 % | 24.01.2028 | 101.394 | 0,30 |
| 200.000 | Caisse de Refinancement de l'Habitat SA [†] | 3,00 % | 11.01.2030 | 202.370 | 0,59 |
| 500.000 | Canadian Imperial Bank of Commerce [†] | 3,25 % | 31.03.2027 | 504.690 | 1,48 |
| 300.000 | Carmila SA [†] | 5,50 % | 09.10.2028 | 311.448 | 0,92 |
| 100.000 | Cirsa Finance International Sarl [†] | 4,50 % | 15.03.2027 | 96.531 | 0,28 |
| 300.000 | Commerzbank AG [†] | 6,75 % | 05.10.2033 | 320.100 | 0,94 |
| 300.000 | Commonwealth Bank of Australia [†] | 0,75 % | 28.02.2028 | 275.157 | 0,81 |
| 100.000 | CPI Property Group SA [†] | 1,63 % | 23.04.2027 | 73.713 | 0,22 |
| 100.000 | CPI Property Group SA [†] | 2,75 % | 12.05.2026 | 83.735 | 0,25 |
| 400.000 | Credit Agricole Home Loan SFH SA [†] | 3,13 % | 18.10.2030 | 407.096 | 1,20 |
| 100.000 | Credit Mutuel Home Loan SFH SA [†] | 2,75 % | 08.12.2027 | 100.001 | 0,29 |
| 300.000 | Cullinan Holdco Scsp ^{**} | 4,63 % | 15.10.2026 | 234.510 | 0,69 |
| 400.000 | Digital Intrepid Holding BV [†] | 1,38 % | 18.07.2032 | 326.604 | 0,96 |

Euro Bond Absolute Return - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert EUR | % des Nettöver- mögens |
|--|--|---------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 54,54 % (31. Dezember 2022: 49,33 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Euro (Fortsetzung) | | | | | |
| 200.000 | Electricite de France SA* | 2,88 % | 29.12.2049 | 185.920 | 0,55 |
| 200.000 | EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG* | 1,38 % | 31.08.2081 | 171.167 | 0,50 |
| 100.000 | EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG* | 2,13 % | 31.08.2081 | 78.231 | 0,23 |
| 100.000 | Energia Group Roi Financeco DAC** | 6,88 % | 31.07.2028 | 104.090 | 0,31 |
| 100.000 | Energizer Gamma Acquisition BV** | 3,50 % | 30.06.2029 | 86.532 | 0,25 |
| 100.000 | Engie SA* | 1,88 % | 29.12.2049 | 83.157 | 0,24 |
| 200.000 | Evonik Industries AG* | 1,38 % | 02.09.2081 | 177.831 | 0,52 |
| 200.000 | Fastighets AB Balder* | 1,88 % | 23.01.2026 | 182.703 | 0,54 |
| 300.000 | Federation des Caisses Desjardins du Quebec* | 2,88 % | 28.11.2024 | 298.150 | 0,88 |
| 300.000 | Global Payments Inc* | 4,88 % | 17.03.2031 | 315.718 | 0,93 |
| 100.000 | Grand City Properties SA* | 1,50 % | 29.12.2049 | 45.998 | 0,14 |
| 300.000 | Grand City Properties SA* | 5,90 % | 29.12.2049 | 172.085 | 0,51 |
| 600.000 | Heimstaden Bostad AB* | 3,38 % | 29.12.2049 | 254.784 | 0,75 |
| 200.000 | Holcim Finance Luxembourg SA* | 3,00 % | 29.12.2049 | 198.668 | 0,58 |
| 250.000 | HSBC Bank Canada* | 1,50 % | 15.09.2027 | 238.395 | 0,70 |
| 200.000 | Iberdrola Finanzas SA* | 1,58 % | 29.12.2049 | 178.506 | 0,52 |
| 400.000 | Iceland Bondco Plc** | 9,50 % | 15.12.2027 | 400.800 | 1,18 |
| 300.000 | Imerys SA* | 4,75 % | 29.11.2029 | 305.314 | 0,90 |
| 100.000 | Italmatch Chemicals SpA* | 10,00 % | 06.02.2028 | 103.618 | 0,30 |
| 224.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau* | 0,00 % | 15.09.2031 | 185.610 | 0,55 |
| 467.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau** | 0,75 % | 28.06.2028 | 434.590 | 1,28 |
| 551.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau* | 0,75 % | 15.01.2029 | 507.801 | 1,49 |
| 403.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau* | 1,25 % | 30.06.2027 | 387.508 | 1,14 |
| 190.000 | Landsbankinn HF* | 6,38 % | 12.03.2027 | 197.040 | 0,58 |
| 200.000 | Lloyds Bank Plc* | 3,25 % | 02.02.2026 | 200.978 | 0,59 |
| 100.000 | Loxam SAS* | 6,38 % | 15.05.2028 | 104.390 | 0,31 |
| 200.000 | Loxam SAS* | 6,38 % | 31.05.2029 | 207.694 | 0,61 |
| 100.000 | Maxeda DIY Holding BV** | 5,88 % | 01.10.2026 | 76.463 | 0,22 |
| 500.000 | National Australia Bank Ltd* | 2,35 % | 30.08.2029 | 484.056 | 1,42 |
| 200.000 | National Grid North America Inc* | 4,67 % | 12.09.2033 | 213.879 | 0,63 |
| 200.000 | Pinnacle Bidco Plc* | 8,25 % | 11.10.2028 | 208.507 | 0,61 |
| 200.000 | Repsol International Finance BV* | 2,50 % | 29.12.2049 | 187.594 | 0,55 |
| 200.000 | Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB* | 2,63 % | 29.12.2049 | 33.280 | 0,10 |
| 200.000 | Sogecap SA* | 6,50 % | 16.05.2044 | 216.354 | 0,64 |
| 370.000 | Southern Co* | 1,88 % | 15.09.2081 | 318.249 | 0,94 |
| 100.000 | Sumitomo Mitsui Banking Corp* | 3,60 % | 16.02.2026 | 100.627 | 0,30 |
| 300.000 | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd* | 4,09 % | 19.04.2028 | 311.054 | 0,91 |
| 100.000 | Syensqo SA* | 2,50 % | 29.12.2049 | 95.152 | 0,28 |
| 200.000 | Telecom Italia SpA* | 6,88 % | 15.02.2028 | 213.508 | 0,63 |
| 200.000 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV* | 1,63 % | 15.10.2028 | 171.007 | 0,50 |

Euro Bond Absolute Return - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert EUR | % des Nettover- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 54,54 % (31. Dezember 2022: 49,33 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Euro (Fortsetzung) | | | | | |
| 400.000 | Thames Water Utilities Finance Plc [*] | 4,38 % | 18.01.2031 | 379.231 | 1,11 |
| 300.000 | TotalEnergies SE [*] | 2,13 % | 29.12.2049 | 240.788 | 0,71 |
| 200.000 | Traton Finance Luxembourg SA [*] | 4,50 % | 23.11.2026 | 204.433 | 0,60 |
| 300.000 | UBS Group AG [*] | 2,13 % | 13.10.2026 | 291.718 | 0,86 |
| 300.000 | Unibail-Rodamco-Westfield SE [*] | 7,25 % | 29.12.2049 | 301.094 | 0,88 |
| 400.000 | UniCredit SpA ^{**} | 3,88 % | 29.12.2049 | 342.760 | 1,01 |
| 300.000 | Veolia Environnement SA [*] | 2,50 % | 29.12.2049 | 269.270 | 0,79 |
| 300.000 | Vodafone Group Plc [*] | 3,00 % | 27.08.2080 | 269.222 | 0,79 |
| 200.000 | Volkswagen International Finance NV [*] | 3,88 % | 29.12.2049 | 183.865 | 0,54 |
| 250.000 | Westpac Banking Corp [*] | 0,38 % | 02.04.2026 | 235.922 | 0,69 |
| 100.000 | Wizz Air Finance Co BV [*] | 1,00 % | 19.01.2026 | 92.202 | 0,27 |
| Euro insgesamt | | | | 17.243.626 | 50,68 |
| Unternehmensanleihen insgesamt | | | | 18.558.164 | 54,54 |
| Staatsanleihen 42,49 % (31. Dezember 2022: 40,49 %) | | | | | |
| Tschechische Krone | | | | | |
| 9.000.000 | Czech Republic Government Bond [*] | 4,90 % | 14.04.2034 | 400.377 | 1,18 |
| Tschechische Krone insgesamt | | | | 400.377 | 1,18 |
| Euro | | | | | |
| 210.000 | Acquirente Unico SpA [*] | 2,80 % | 20.02.2026 | 206.333 | 0,61 |
| 857.000 | Bank Gospodarstwa Krajowego [*] | 3,00 % | 30.05.2029 | 837.826 | 2,46 |
| 300.000 | Bank Gospodarstwa Krajowego [*] | 4,00 % | 08.09.2027 | 305.977 | 0,90 |
| 340.000 | Bulgaria Government International Bond [*] | 4,38 % | 13.05.2031 | 357.848 | 1,05 |
| 320.000 | Bulgaria Government International Bond [*] | 4,88 % | 13.05.2036 | 343.269 | 1,01 |
| 60.150 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe [*] | 2,50 % | 15.08.2046 | 62.521 | 0,18 |
| 400.000 | Caisse Francaise de Financement Local [*] | 3,50 % | 20.03.2029 | 414.267 | 1,22 |
| 503.000 | Croatia Government International Bond [*] | 1,50 % | 17.06.2031 | 451.443 | 1,33 |
| 281.000 | European Union [*] | 1,63 % | 04.12.2029 | 268.255 | 0,79 |
| 173.000 | European Union [*] | 2,75 % | 04.12.2037 | 169.929 | 0,50 |
| 379.886 | European Union [*] | 3,25 % | 04.07.2034 | 398.455 | 1,17 |
| 471.000 | European Union [*] | 3,38 % | 04.10.2038 | 495.120 | 1,46 |
| 102.486 | French Republic Government Bond OAT [*] | 0,75 % | 25.05.2052 | 58.869 | 0,17 |
| 406.044 | French Republic Government Bond OAT [*] | 1,25 % | 25.05.2038 | 331.003 | 0,97 |
| 165.438 | French Republic Government Bond OAT [*] | 1,75 % | 25.05.2066 | 118.570 | 0,35 |
| 613.000 | Hellenic Republic Government Bond [*] | 4,38 % | 18.07.2038 | 675.944 | 1,99 |
| 235.000 | Instituto de Credito Oficial [*] | 3,80 % | 31.05.2029 | 247.005 | 0,73 |
| 118.000 | Ireland Government Bond [*] | 3,00 % | 18.10.2043 | 122.833 | 0,36 |
| 227.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro ^{**} | 0,00 % | 01.08.2026 | 211.496 | 0,62 |
| 506.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro ^{**} | 1,20 % | 15.08.2025 | 492.060 | 1,45 |

Euro Bond Absolute Return - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert EUR | % des Nettöver- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 42,49 % (31. Dezember 2022: 40,49 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Euro (Fortsetzung) | | | | | |
| 175.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | 1,60 % | 01.06.2026 | 170.237 | 0,50 |
| 460.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro* | 1,85 % | 01.07.2025 | 452.275 | 1,33 |
| 257.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro* | 3,40 % | 28.03.2025 | 257.710 | 0,76 |
| 330.390 | Netherlands Government Bond* | 0,00 % | 15.07.2030 | 287.529 | 0,84 |
| 239.000 | Republic of Poland Government International Bond* | 3,88 % | 14.02.2033 | 249.934 | 0,73 |
| 291.000 | Romanian Government International Bond* | 1,75 % | 13.07.2030 | 235.854 | 0,69 |
| 380.000 | Romanian Government International Bond* | 2,12 % | 16.07.2031 | 303.986 | 0,89 |
| 507.000 | Romanian Government International Bond* | 3,62 % | 26.05.2030 | 467.425 | 1,37 |
| 280.000 | Romanian Government International Bond* | 6,38 % | 18.09.2033 | 296.664 | 0,87 |
| 207.000 | Romanian Government International Bond* | 6,63 % | 27.09.2029 | 221.788 | 0,65 |
| 700.000 | Slovenia Government Bond* | 1,19 % | 14.03.2029 | 649.183 | 1,91 |
| 313.000 | Slovenia Government Bond* | 1,50 % | 25.03.2035 | 264.911 | 0,78 |
| 313.000 | Slovenia Government Bond* | 3,63 % | 11.03.2033 | 331.466 | 0,97 |
| 140.000 | Spain Government Bond* | 0,50 % | 31.10.2031 | 117.932 | 0,35 |
| 526.000 | Spain Government Bond* | 0,70 % | 30.04.2032 | 444.312 | 1,31 |
| 650.000 | Spain Government Bond* | 1,85 % | 30.07.2035 | 572.302 | 1,68 |
| 947.000 | Spain Government Bond* | 3,55 % | 31.10.2033 | 992.970 | 2,92 |
| 186.000 | State of North Rhine-Westphalia Germany* | 1,45 % | 16.02.2043 | 144.134 | 0,42 |
| Euro insgesamt | | | | 13.029.635 | 38,29 |
| Polnischer Zloty | | | | | |
| 4.200.000 | Republic of Poland Government Bond* | 6,00 % | 25.10.2033 | 1.026.138 | 3,02 |
| Polnischer Zloty insgesamt | | | | 1.026.138 | 3,02 |
| Staatsanleihen insgesamt | | | | 14.456.150 | 42,49 |
| Anlagen insgesamt | | | | 33.173.041 | 97,49 |

Devisenterminkontrakte 0,08 % (31. Dezember 2022: 0,08 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeits- datum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn EUR | % des Nettöver- mögens |
|---|------------------------|-----------------------|--------------------------------|-----------|-------------------------------------|------------------------------|
| 1.890.938 € | 14.087.178 DKK | 18.01.2024 | BNP Paribas | 1 | 864 | 0,00 |
| 439.624 € | 10.811.901 CZK | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 2.185 | 0,01 |
| 3.913 € | 4.139 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 168 | 0,00 |
| 1.740 € | 268.992 ¥ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 10 | 0,00 |
| 13.010 £ | 14.969 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 36 | 0,00 |
| 252.182 PLN | 58.000 € | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 8 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen USD</i> | | | | | | |
| 1.457.909 € | 1.587.400 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | 21.787 | 0,07 |
| 153.713 US\$ | 138.739 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 325 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ^o | | | | | 25.383 | 0,08 |

Euro Bond Absolute Return - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Futures-Kontrakte 0,14 % (31. Dezember 2022: 3,09 %)

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Gewinn EUR | % des Nettovermögens |
|---|--|-------------------------------|----------------------|
| 29 | Euro-BOBL Future March 2024 | 37.990 | 0,11 |
| 13 | Canadian 2-Year Bond Future March 2024 | 7.745 | 0,02 |
| 2 | Short-Term Euro-BTP Future March 2024 | 1.300 | 0,01 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten * | | 47.035 | 0,14 |

Inflation-Swap-Kontrakte 0,08 % (31. Dezember 2022: 0,13 %)

| Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei | Erhalt/(Zahlung) [#] | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Gewinn EUR | % des Nettovermögens |
|---|------------|-------------------------------|-------------------------------|-----------------|--------------------|-------------------------------|----------------------|
| EUR 1.500.000 | 15.11.2033 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 2,32 % | CPTFEMU | 26.569 | 0,08 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten [∞] | | | | | | 26.569 | 0,08 |

[#]Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.
(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

¹Zentral abgewickelter Swap.

Zinsswap-Kontrakte 0,33 % (31. Dezember 2022: 0,03 %)

| Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei | Erhalt/(Zahlung) [#] | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Gewinn EUR | % des Nettovermögens |
|--|------------|-------------------------------|-------------------------------|-----------------|--------------------|-------------------------------|----------------------|
| EUR 1.400.000 | 26.10.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 3,09 % | 1D €STR | 57.656 | 0,17 |
| EUR 2.300.000 | 26.10.2026 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 3,24 % | 1D €STR | 56.225 | 0,16 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten [∞] | | | | | | 113.881 | 0,33 |

[#]Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.
(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

¹Zentral abgewickelter Swap.

| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | Zeitwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|-------------------|----------------------|
| | 33.385.909 | 98,12 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (3,29 %) (31. Dezember 2022: (2,13 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust EUR | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 10.641.433 CZK | 432.290 € | 18.01.2024 | BNP Paribas | 1 | (1.748) | (0,00) |
| 735.546 CZK | 29.931 € | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | (172) | (0,00) |
| 4.606.678 DKK | 618.161 € | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 2 | (84) | (0,00) |
| 680.646 € | 3.100.874 PLN | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 3 | (32.630) | (0,10) |
| 342.503 € | 299.707 £ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | (3.183) | (0,01) |
| 282.268 € | 1.265.280 PLN | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | (8.777) | (0,03) |
| 12.249 € | 10.646 £ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (30) | (0,00) |

Euro Bond Absolute Return - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (3,29 %) (31. Dezember 2022: (2,13 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust EUR | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 1.008.941 ¥ | 6.526 € | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | (35) | (0,00) |
| 933 US\$ | 882 € | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | (38) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen USD</i> | | | | | | |
| 15.119.666 US\$ | 14.189.476 € | 18.01.2024 | BNP Paribas | 1 | (510.705) | (1,50) |
| 1.243.088 US\$ | 1.155.344 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 5 | (30.722) | (0,09) |
| 199.330 US\$ | 182.482 € | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | (2.148) | (0,01) |
| 15.291.273 US\$ | 14.361.510 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | (527.485) | (1,55) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | (1.117.757) | (3,29) |

Futures-Kontrakte (0,89 %) (31. Dezember 2022: (0,21 %))

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Verlust EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|--------------------------------|----------------------|
| (8) | 10-Year Mini Japanese Government Bond Future March 2024 | (944) | (0,00) |
| 15 | Euro-BOBL Put Option on Future February 2024, Strike Price EUR 118.00 | (2.927) | (0,01) |
| (12) | Euro-BTP Future March 2024 | (37.440) | (0,11) |
| (37) | Euro-Bund Future March 2024 | (102.490) | (0,30) |
| (19) | Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2024 | (134.520) | (0,40) |
| (12) | Euro-OAT Future March 2024 | (23.510) | (0,07) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten [*] | | (301.831) | (0,89) |

Inflation-Swap-Kontrakte (0,04 %) (31. Dezember 2022: (0,14 %))

| Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei | Erhalt/(Zahlung) [#] | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Verlust EUR | % des Nettovermögens |
|--|------------|-------------------------------|-------------------------------|-----------------|--------------------|--------------------------------|----------------------|
| EUR 1.500.000 | 15.11.2028 | LCH Clearent Ltd ¹ | Erhalt | 2,21 % | CPTFEMU | (14.661) | (0,04) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Inflation-Swap-Kontrakten [∞] | | | | | | (14.661) | (0,04) |

[#]Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.
(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

¹Zentral abgewickelter Swap.

Credit-Default-Swap-Kontrakte (0,53 %) (31. Dezember 2022: (0,07 %))

| Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei | Referenzverbindlichkeit | Zeitwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|------------|-----------------------------|--|------------------|----------------------|
| EUR 2.260.000 | 20.12.2028 | ICE Clear U.S. ¹ | Buying default protection on iTRAXX Europe Crossover S40 | (181.087) | (0,53) |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt [*] | | | | (181.087) | (0,53) |

¹Zentral abgewickelter Swap.

Euro Bond Absolute Return - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| | Zeitwert EUR | % des Netto- vermögens |
|---|--------------------|------------------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (1.615.336) | (4,75) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | 31.770.573 | 93,37 |
| Sonstiges Nettovermögen | 2.256.254 | 6,63 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | 34.026.827 | 100,00 |

| Portfolioanalyse | EUR | % des Gesamtver- mögens |
|---|-------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 30.274.800 | 83,76 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 2.898.241 | 8,02 |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | (254.796) | (0,70) |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap | (1.147.672) | (3,18) |
| Anlagen insgesamt | 31.770.573 | 87,90 |

European High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert EUR | % des Netto- vermögens |
|---|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 0,59 % (31. Dezember 2022: 0,66 %) | | | | | |
| Euro | | | | | |
| 400.000 | Blackrock European CLO XIV DAC Series 14X Class E | 11,61 % | 15.07.2036 | 398.391 | 0,10 |
| 500.000 | Contego CLO XII DAC Series 12X Class E | 11,97 % | 25.01.2038 | 499.043 | 0,12 |
| 300.000 | CVC Cordatus Loan Fund XXVII DAC Series 27X Class F | 14,32 % | 15.04.2035 | 303.643 | 0,08 |
| 300.000 | Otranto Park CLO DAC Series 1X Class E | 11,05 % | 15.05.2035 | 292.664 | 0,07 |
| 375.000 | RRE 5 Loan Management DAC Series 5X Class DR | 10,29 % | 15.01.2037 | 364.666 | 0,09 |
| 350.000 | Vesey Park CLO DAC Series 1X Class E | 13,88 % | 16.11.2032 | 341.694 | 0,08 |
| Euro insgesamt | | | | 2.200.101 | 0,54 |
| US-Dollar | | | | | |
| 250.000 | Flatiron CLO 17 Ltd Series 2017-1X Class ER | 11,54 % | 15.05.2030 | 225.240 | 0,05 |
| US-Dollar insgesamt | | | | 225.240 | 0,05 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt ** | | | | 2.425.341 | 0,59 |
| Unternehmensanleihen 94,13 % (31. Dezember 2022: 98,80 %) | | | | | |
| Euro | | | | | |
| 4.500.000 | Abertis Infraestructuras Finance BV* | 3,25 % | 29.12.2049 | 4.330.836 | 1,06 |
| 1.400.000 | Accor SA* | 7,25 % | 29.12.2049 | 1.526.657 | 0,37 |
| 1.100.000 | Adevinta ASA* | 3,00 % | 15.11.2027 | 1.097.140 | 0,27 |
| 1.620.000 | Afflelou SAS* | 4,25 % | 19.05.2026 | 1.617.975 | 0,40 |
| 1.595.000 | Altice Financing SA* | 2,25 % | 15.01.2025 | 1.553.227 | 0,38 |
| 3.425.000 | Altice Financing SA** | 4,25 % | 15.08.2029 | 3.049.106 | 0,75 |
| 1.829.000 | Altice France Holding SA* | 4,00 % | 15.02.2028 | 817.481 | 0,20 |
| 950.000 | Altice France Holding SA* | 8,00 % | 15.05.2027 | 548.371 | 0,13 |
| 980.000 | Altice France SA** | 2,13 % | 15.02.2025 | 947.679 | 0,23 |
| 150.000 | Altice France SA* | 3,38 % | 15.01.2028 | 119.457 | 0,03 |
| 3.665.000 | Altice France SA** | 4,13 % | 15.01.2029 | 2.940.136 | 0,72 |
| 1.000.000 | Altice France SA* | 5,88 % | 01.02.2027 | 894.865 | 0,22 |
| 1.418.000 | Aramark International Finance Sarl* | 3,13 % | 01.04.2025 | 1.414.855 | 0,35 |
| 1.655.000 | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc* | 3,00 % | 01.09.2029 | 1.339.324 | 0,33 |
| 1.875.000 | Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc* | 2,13 % | 15.08.2026 | 1.676.917 | 0,41 |
| 995.000 | Arena Luxembourg Finance Sarl* | 1,88 % | 01.02.2028 | 892.209 | 0,22 |
| 1.745.000 | Ashland Services BV** | 2,00 % | 30.01.2028 | 1.626.106 | 0,40 |
| 1.996.000 | Assemblin Group AB** | 8,96 % | 05.07.2029 | 2.030.690 | 0,50 |
| 2.370.000 | Avantor Funding Inc* | 3,88 % | 15.07.2028 | 2.326.819 | 0,57 |
| 3.172.000 | Avis Budget Finance Plc** | 7,25 % | 31.07.2030 | 3.404.971 | 0,83 |
| 620.000 | Balder Finland OYJ* | 2,00 % | 18.01.2031 | 455.278 | 0,11 |
| 2.117.000 | Banijay Entertainment SASU** | 7,00 % | 01.05.2029 | 2.238.816 | 0,55 |
| 993.000 | Banijay Group SAS** | 6,50 % | 01.03.2026 | 994.534 | 0,24 |
| 2.800.000 | Bayer AG* | 5,38 % | 25.03.2082 | 2.666.460 | 0,65 |

European High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert EUR | % des Nettöver- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 94,13 % (31. Dezember 2022: 98,80 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Euro (Fortsetzung) | | | | | |
| 2.000.000 | Bayer AG [*] | 7,00 % | 25.09.2083 | 2.069.682 | 0,51 |
| 1.600.000 | BCP V Modular Services Finance II Plc ^{**} | 4,75 % | 30.11.2028 | 1.490.594 | 0,37 |
| 1.008.000 | BCP V Modular Services Finance Plc ^{**} | 6,75 % | 30.11.2029 | 831.746 | 0,20 |
| 1.775.000 | Belden Inc [*] | 3,38 % | 15.07.2031 | 1.570.170 | 0,38 |
| 1.306.000 | Belden Inc [*] | 3,88 % | 15.03.2028 | 1.271.144 | 0,31 |
| 1.494.000 | Benteler International AG [*] | 9,38 % | 15.05.2028 | 1.599.736 | 0,39 |
| 3.567.000 | Birkenstock Financing Sarl [*] | 5,25 % | 30.04.2029 | 3.558.404 | 0,87 |
| 1.228.000 | Boels Topholding BV ^{**} | 6,25 % | 15.02.2029 | 1.286.382 | 0,32 |
| 1.745.000 | Canpack SA/Canpack US LLC [*] | 2,38 % | 01.11.2027 | 1.604.021 | 0,39 |
| 1.210.000 | Castle UK Finco Plc ^{**} | 9,25 % | 15.05.2028 | 1.123.757 | 0,28 |
| 4.200.000 | CECONOMY AG [*] | 1,75 % | 24.06.2026 | 3.661.405 | 0,90 |
| 1.400.000 | Cellnex Finance Co SA [*] | 1,50 % | 08.06.2028 | 1.285.367 | 0,31 |
| 5.200.000 | Cellnex Telecom SA [*] | 1,75 % | 23.10.2030 | 4.568.850 | 1,12 |
| 1.550.000 | Cheplapharm Arzneimittel GmbH ^{**} | 4,38 % | 15.01.2028 | 1.515.272 | 0,37 |
| 2.043.000 | Cheplapharm Arzneimittel GmbH [*] | 7,50 % | 15.05.2030 | 2.181.744 | 0,53 |
| 2.455.000 | Clarios Global LP/Clarios US Finance Co ^{**} | 4,38 % | 15.05.2026 | 2.442.637 | 0,60 |
| 1.152.000 | Constellium SE [*] | 3,13 % | 15.07.2029 | 1.062.720 | 0,26 |
| 740.000 | Constellium SE [*] | 4,25 % | 15.02.2026 | 738.432 | 0,18 |
| 900.000 | Coty Inc ^{**} | 3,88 % | 15.04.2026 | 900.494 | 0,22 |
| 461.000 | Coty Inc ^{**} | 5,75 % | 15.09.2028 | 486.712 | 0,12 |
| 2.495.000 | CPI Property Group SA [*] | 1,75 % | 14.01.2030 | 1.425.995 | 0,35 |
| 2.680.000 | Ctec II GmbH ^{**} | 5,25 % | 15.02.2030 | 2.408.650 | 0,59 |
| 1.270.000 | Cullinan Holdco Scsp ^{**} | 4,63 % | 15.10.2026 | 992.759 | 0,24 |
| 3.325.000 | Dana Financing Luxembourg Sarl [*] | 8,50 % | 15.07.2031 | 3.648.373 | 0,89 |
| 2.000.000 | Deutsche Lufthansa AG [*] | 3,50 % | 14.07.2029 | 1.952.258 | 0,48 |
| 2.500.000 | Deutsche Lufthansa AG [*] | 3,75 % | 11.02.2028 | 2.472.905 | 0,61 |
| 5.945.000 | Douglas GmbH [*] | 6,00 % | 08.04.2026 | 5.892.595 | 1,44 |
| 4.600.000 | EDP - Energias de Portugal SA [*] | 5,94 % | 23.04.2083 | 4.784.138 | 1,17 |
| 605.000 | eircom Finance DAC ^{**} | 2,63 % | 15.02.2027 | 570.730 | 0,14 |
| 4.200.000 | Electricite de France SA [*] | 2,63 % | 29.12.2049 | 3.746.358 | 0,92 |
| 1.600.000 | Electricite de France SA [*] | 4,00 % | 29.12.2049 | 1.590.306 | 0,39 |
| 1.800.000 | Electricite de France SA [*] | 5,00 % | 29.12.2049 | 1.801.269 | 0,44 |
| 3.200.000 | Electricite de France SA [*] | 7,50 % | 29.12.2049 | 3.501.466 | 0,86 |
| 1.465.000 | Elior Group SA [*] | 3,75 % | 15.07.2026 | 1.358.919 | 0,33 |
| 654.000 | Emerald Debt Merger Sub LLC ^{**} | 6,38 % | 15.12.2030 | 701.350 | 0,17 |
| 664.000 | Emeria SASU ^{**} | 3,38 % | 31.03.2028 | 572.069 | 0,14 |
| 810.000 | Emeria SASU ^{**} | 7,75 % | 31.03.2028 | 787.016 | 0,19 |
| 3.110.000 | Energizer Gamma Acquisition BV ^{**} | 3,50 % | 30.06.2029 | 2.691.146 | 0,66 |
| 2.028.000 | Ephios Subco 3 Sarl ^{**} | 7,88 % | 31.01.2031 | 2.102.610 | 0,52 |

European High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert EUR | % des Nettöver- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 94,13 % (31. Dezember 2022: 98,80 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Euro (Fortsetzung) | | | | | |
| 2.654.000 | Eroski S Coop [*] | 10,63 % | 30.04.2029 | 2.741.075 | 0,67 |
| 2.100.000 | Fastighets AB Balder [*] | 2,87 % | 02.06.2081 | 1.590.355 | 0,39 |
| 1.140.000 | Fiber Bidco SpA [*] | 9,89 % | 25.10.2027 | 1.161.649 | 0,28 |
| 1.515.000 | Fiber Bidco SpA [*] | 11,00 % | 25.10.2027 | 1.658.925 | 0,41 |
| 1.200.000 | Food Service Project SA [*] | 5,50 % | 21.01.2027 | 1.202.538 | 0,29 |
| 1.200.000 | Ford Motor Credit Co LLC [*] | 3,02 % | 06.03.2024 | 1.196.588 | 0,29 |
| 710.000 | Ford Motor Credit Co LLC [*] | 4,87 % | 03.08.2027 | 730.804 | 0,18 |
| 500.000 | Forvia SE [*] | 3,13 % | 15.06.2026 | 491.512 | 0,12 |
| 1.525.000 | Forvia SE [*] | 3,75 % | 15.06.2028 | 1.498.291 | 0,37 |
| 3.265.000 | Forvia SE [*] | 7,25 % | 15.06.2026 | 3.469.291 | 0,85 |
| 1.295.000 | Grifols SA [*] | 1,63 % | 15.02.2025 | 1.269.691 | 0,31 |
| 1.055.000 | Grifols SA [*] | 3,20 % | 01.05.2025 | 1.035.117 | 0,25 |
| 2.070.000 | Grifols SA [*] | 3,88 % | 15.10.2028 | 1.896.557 | 0,46 |
| 740.000 | Gruenthal GmbH [*] | 3,63 % | 15.11.2026 | 732.230 | 0,18 |
| 700.000 | Gruenthal GmbH ^{**} | 4,13 % | 15.05.2028 | 694.409 | 0,17 |
| 150.000 | Grupo Antolin-Irausa SA [*] | 3,38 % | 30.04.2026 | 133.331 | 0,03 |
| 2.235.000 | Grupo Antolin-Irausa SA [*] | 3,50 % | 30.04.2028 | 1.708.356 | 0,42 |
| 2.071.000 | Guala Closures SpA [*] | 3,25 % | 15.06.2028 | 1.954.506 | 0,48 |
| 900.000 | Heimstaden Bostad AB [*] | 3,00 % | 29.12.2049 | 316.449 | 0,08 |
| 1.760.000 | Heimstaden Bostad AB [*] | 3,25 % | 29.12.2049 | 922.680 | 0,23 |
| 440.000 | Heimstaden Bostad Treasury BV [*] | 0,75 % | 06.09.2029 | 290.813 | 0,07 |
| 200.000 | Heimstaden Bostad Treasury BV [*] | 1,38 % | 24.07.2028 | 144.144 | 0,04 |
| 1.350.000 | Heimstaden Bostad Treasury BV [*] | 1,63 % | 13.10.2031 | 856.632 | 0,21 |
| 1.320.000 | House of HR Group BV ^{**} | 9,00 % | 03.11.2029 | 1.376.029 | 0,34 |
| 860.000 | IHO Verwaltungs GmbH [*] | 3,75 % | 15.09.2026 | 850.337 | 0,21 |
| 1.200.000 | IHO Verwaltungs GmbH [*] | 3,88 % | 15.05.2027 | 1.178.531 | 0,29 |
| 3.249.000 | IHO Verwaltungs GmbH [*] | 8,75 % | 15.05.2028 | 3.547.388 | 0,87 |
| 3.560.000 | Iliad Holding SASU ^{**} | 5,13 % | 15.10.2026 | 3.559.694 | 0,87 |
| 810.000 | Iliad Holding SASU ^{**} | 5,63 % | 15.10.2028 | 815.420 | 0,20 |
| 200.000 | iliad SA [*] | 5,38 % | 14.06.2027 | 205.917 | 0,05 |
| 3.613.000 | INEOS Quattro Finance 1 Plc [*] | 3,75 % | 15.07.2026 | 3.498.042 | 0,86 |
| 1.192.000 | INEOS Quattro Finance 2 Plc [*] | 8,50 % | 15.03.2029 | 1.261.529 | 0,31 |
| 1.000.000 | Infineon Technologies AG [*] | 2,88 % | 29.12.2049 | 978.465 | 0,24 |
| 700.000 | Infineon Technologies AG [*] | 3,63 % | 29.12.2049 | 673.892 | 0,17 |
| 2.700.000 | International Consolidated Airlines Group SA [*] | 3,75 % | 25.03.2029 | 2.625.264 | 0,64 |
| 203.233 | Intrum AB [*] | 3,13 % | 15.07.2024 | 199.852 | 0,05 |
| 597.000 | IPD 3 BV [*] | 8,00 % | 15.06.2028 | 639.068 | 0,16 |
| 900.000 | IQVIA Inc ^{**} | 2,88 % | 15.06.2028 | 860.418 | 0,21 |
| 1.000.000 | Italmatch Chemicals SpA [*] | 10,00 % | 06.02.2028 | 1.036.180 | 0,25 |
| 3.295.000 | Jaguar Land Rover Automotive Plc [*] | 4,50 % | 15.07.2028 | 3.227.700 | 0,79 |

European High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert EUR | % des Nettöver- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 94,13 % (31. Dezember 2022: 98,80 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Euro (Fortsetzung) | | | | | |
| 770.000 | Jaguar Land Rover Automotive Plc [†] | 6,88 % | 15.11.2026 | 824.476 | 0,20 |
| 1.170.000 | Kaixo Bondco Telecom SA [†] | 5,13 % | 30.09.2029 | 1.099.800 | 0,27 |
| 1.756.000 | Kapla Holding SAS [†] | 3,38 % | 15.12.2026 | 1.705.060 | 0,42 |
| 526.000 | Kapla Holding SAS [†] | 9,47 % | 15.07.2027 | 537.243 | 0,13 |
| 2.470.000 | Koninklijke KPN NV [†] | 6,00 % | 29.12.2049 | 2.564.725 | 0,63 |
| 860.000 | Kronos International Inc ^{**} | 3,75 % | 15.09.2025 | 826.998 | 0,20 |
| 1.525.000 | Lion/Polaris Lux 4 SA [†] | 7,93 % | 01.07.2026 | 1.525.907 | 0,37 |
| 6.925.000 | Lorca Telecom Bondco SA [†] | 4,00 % | 18.09.2027 | 6.777.809 | 1,66 |
| 2.202.000 | Loxam SAS [†] | 5,75 % | 15.07.2027 | 2.175.686 | 0,53 |
| 648.000 | Loxam SAS [†] | 6,38 % | 15.05.2028 | 676.447 | 0,17 |
| 1.700.000 | Loxam SAS [†] | 6,38 % | 31.05.2029 | 1.765.399 | 0,43 |
| 1.620.000 | Lune Holdings Sarl ^{**} | 5,63 % | 15.11.2028 | 1.327.086 | 0,33 |
| 1.055.000 | Matterhorn Telecom SA ^{**} | 3,13 % | 15.09.2026 | 1.024.006 | 0,25 |
| 1.662.000 | Monitchem HoldCo 3 SA [†] | 8,75 % | 01.05.2028 | 1.702.172 | 0,42 |
| 3.025.000 | Mooney Group SpA ^{**} | 7,81 % | 17.12.2026 | 2.981.588 | 0,73 |
| 3.227.000 | Motion Finco Sarl [†] | 7,38 % | 15.06.2030 | 3.306.649 | 0,81 |
| 3.556.000 | Multiversity SRL [†] | 8,20 % | 30.10.2028 | 3.576.358 | 0,88 |
| 1.310.000 | Nidda BondCo GmbH ^{**} | 5,00 % | 30.09.2025 | 1.300.725 | 0,32 |
| 3.090.000 | Nidda Healthcare Holding GmbH ^{**} | 7,50 % | 21.08.2026 | 3.190.382 | 0,78 |
| 1.410.000 | Nobian Finance BV [†] | 3,63 % | 15.07.2026 | 1.358.887 | 0,33 |
| 400.000 | Olympus Water US Holding Corp [†] | 3,88 % | 01.10.2028 | 367.760 | 0,09 |
| 100.000 | Olympus Water US Holding Corp [†] | 5,38 % | 01.10.2029 | 85.837 | 0,02 |
| 1.930.000 | Olympus Water US Holding Corp [†] | 9,63 % | 15.11.2028 | 2.074.634 | 0,51 |
| 640.000 | Organon & Co/Organon Foreign Debt Co-Issuer BV [†] | 2,88 % | 30.04.2028 | 589.500 | 0,14 |
| 417.000 | Paprec Holding SA ^{**} | 6,50 % | 17.11.2027 | 446.650 | 0,11 |
| 1.176.000 | PCF GmbH [†] | 4,75 % | 15.04.2026 | 862.798 | 0,21 |
| 2.315.000 | PEU Finance Plc [†] | 7,25 % | 01.07.2028 | 2.388.730 | 0,59 |
| 1.340.000 | Piaggio & C SpA [†] | 6,50 % | 05.10.2030 | 1.417.461 | 0,35 |
| 150.000 | Picard Bondco SA [†] | 5,38 % | 01.07.2027 | 141.352 | 0,03 |
| 2.120.000 | Picard Groupe SAS [†] | 3,88 % | 01.07.2026 | 2.071.106 | 0,51 |
| 1.720.000 | PLT VII Finance Sarl ^{**} | 4,63 % | 05.01.2026 | 1.714.659 | 0,42 |
| 1.600.000 | PrestigeBidCo GmbH ^{**} | 9,97 % | 15.07.2027 | 1.628.982 | 0,40 |
| 2.445.000 | Primo Water Holdings Inc ^{**} | 3,88 % | 31.10.2028 | 2.365.797 | 0,58 |
| 2.405.000 | Q-Park Holding I BV ^{**} | 1,50 % | 01.03.2025 | 2.362.215 | 0,58 |
| 1.200.000 | RCS & RDS SA [†] | 2,50 % | 05.02.2025 | 1.177.552 | 0,29 |
| 100.000 | RCS & RDS SA [†] | 3,25 % | 05.02.2028 | 89.626 | 0,02 |
| 700.000 | Rossini Sarl [†] | 6,75 % | 30.10.2025 | 702.218 | 0,17 |
| 760.000 | Rossini Sarl [†] | 7,83 % | 30.10.2025 | 763.800 | 0,19 |
| 1.100.000 | Schaeffler AG [†] | 3,38 % | 12.10.2028 | 1.068.345 | 0,26 |
| 2.605.000 | SES SA [†] | 2,88 % | 29.12.2049 | 2.376.104 | 0,58 |

European High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert EUR | % des Nettöver- mögens |
|--|--|---------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 94,13 % (31. Dezember 2022: 98,80 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Euro (Fortsetzung) | | | | | |
| 1.850.000 | SES SA* | 5,63 % | 29.12.2049 | 1.853.219 | 0,45 |
| 845.000 | Sigma Holdco BV** | 5,75 % | 15.05.2026 | 760.677 | 0,19 |
| 850.000 | SNF Group SACA* | 2,63 % | 01.02.2029 | 783.419 | 0,19 |
| 180.211 | Summer BC Holdco A Sarl** | 9,25 % | 31.10.2027 | 161.794 | 0,04 |
| 1.420.000 | Summer BC Holdco B Sarl** | 5,75 % | 31.10.2026 | 1.364.715 | 0,33 |
| 1.672.000 | Summit Properties Ltd* | 2,00 % | 31.01.2025 | 1.576.069 | 0,39 |
| 1.210.000 | Synthomer Plc* | 3,88 % | 01.07.2025 | 1.199.848 | 0,29 |
| 3.450.852 | Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH** | 6,00 % | 30.07.2026 | 3.453.612 | 0,85 |
| 1.650.000 | Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH** | 2,00 % | 15.07.2025 | 1.618.142 | 0,40 |
| 110.000 | Telecom Italia Finance SA* | 7,75 % | 24.01.2033 | 128.618 | 0,03 |
| 2.165.000 | Telecom Italia SpA** | 1,63 % | 18.01.2029 | 1.877.185 | 0,46 |
| 1.110.000 | Telecom Italia SpA* | 2,38 % | 12.10.2027 | 1.040.400 | 0,25 |
| 800.000 | Telecom Italia SpA* | 2,88 % | 28.01.2026 | 776.132 | 0,19 |
| 200.000 | Telecom Italia SpA** | 3,00 % | 30.09.2025 | 195.666 | 0,05 |
| 3.770.000 | Telecom Italia SpA** | 4,00 % | 11.04.2024 | 3.761.476 | 0,92 |
| 4.667.000 | Telecom Italia SpA* | 7,88 % | 31.07.2028 | 5.197.638 | 1,27 |
| 1.500.000 | Telefonica Europe BV* | 2,88 % | 29.12.2049 | 1.400.292 | 0,34 |
| 200.000 | Telefonica Europe BV* | 3,88 % | 29.12.2049 | 194.044 | 0,05 |
| 1.900.000 | Telefonica Europe BV* | 4,38 % | 29.12.2049 | 1.889.664 | 0,46 |
| 2.100.000 | Telefonica Europe BV* | 6,14 % | 29.12.2049 | 2.164.460 | 0,53 |
| 2.300.000 | Telefonica Europe BV* | 6,75 % | 29.12.2049 | 2.461.545 | 0,60 |
| 198.000 | Tendam Brands SAU* | 11,45 % | 31.03.2028 | 201.589 | 0,05 |
| 1.475.000 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV* | 1,63 % | 15.10.2028 | 1.261.178 | 0,31 |
| 2.100.000 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV* | 4,38 % | 09.05.2030 | 1.977.181 | 0,48 |
| 1.330.000 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV* | 4,50 % | 01.03.2025 | 1.332.660 | 0,33 |
| 1.230.000 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV* | 6,00 % | 31.01.2025 | 1.244.850 | 0,30 |
| 2.830.000 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV* | 7,38 % | 15.09.2029 | 3.104.485 | 0,76 |
| 702.000 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV* | 7,88 % | 15.09.2031 | 797.559 | 0,20 |
| 1.683.000 | Titan Holdings II BV* | 5,13 % | 15.07.2029 | 1.447.380 | 0,35 |
| 2.088.000 | TK Elevator Holdco GmbH** | 6,63 % | 15.07.2028 | 1.934.342 | 0,47 |
| 1.725.000 | TK Elevator Midco GmbH** | 4,38 % | 15.07.2027 | 1.673.595 | 0,41 |
| 350.000 | TK Elevator Midco GmbH** | 8,72 % | 15.07.2027 | 355.950 | 0,09 |
| 700.000 | TMNL Holding BV** | 3,75 % | 15.01.2029 | 666.383 | 0,16 |
| 1.415.000 | Trivium Packaging Finance BV* | 3,75 % | 15.08.2026 | 1.374.743 | 0,34 |
| 4.120.000 | UGI International LLC** | 2,50 % | 01.12.2029 | 3.518.711 | 0,86 |
| 600.000 | United Group BV** | 3,13 % | 15.02.2026 | 576.726 | 0,14 |
| 800.000 | United Group BV* | 4,00 % | 15.11.2027 | 759.646 | 0,19 |
| 1.700.000 | United Group BV** | 5,25 % | 01.02.2030 | 1.615.901 | 0,40 |
| 750.000 | UPC Holding BV* | 3,88 % | 15.06.2029 | 697.694 | 0,17 |
| 1.060.000 | UPCB Finance VII Ltd* | 3,63 % | 15.06.2029 | 1.016.049 | 0,25 |

European High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert EUR | % des Nettöver- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 94,13 % (31. Dezember 2022: 98,80 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Euro (Fortsetzung) | | | | | |
| 200.000 | Valeo SE* | 1,00 % | 03.08.2028 | 175.658 | 0,04 |
| 2.800.000 | Valeo SE* | 5,38 % | 28.05.2027 | 2.913.078 | 0,71 |
| 900.000 | Valeo SE* | 5,88 % | 12.04.2029 | 967.447 | 0,24 |
| 600.000 | Veolia Environnement SA* | 2,25 % | 29.12.2049 | 568.115 | 0,14 |
| 1.000.000 | Veolia Environnement SA* | 2,50 % | 29.12.2049 | 897.567 | 0,22 |
| 1.700.000 | Verisure Holding AB* | 3,25 % | 15.02.2027 | 1.636.701 | 0,40 |
| 2.385.000 | Verisure Holding AB* | 3,88 % | 15.07.2026 | 2.347.567 | 0,57 |
| 2.676.000 | Verisure Midholding AB* | 5,25 % | 15.02.2029 | 2.562.297 | 0,63 |
| 500.000 | Virgin Media Finance Plc** | 3,75 % | 15.07.2030 | 460.625 | 0,11 |
| 400.000 | Vodafone Group Plc* | 2,63 % | 27.08.2080 | 381.138 | 0,09 |
| 450.000 | Vodafone Group Plc* | 3,00 % | 27.08.2080 | 403.833 | 0,10 |
| 2.220.000 | Vodafone Group Plc* | 4,20 % | 03.10.2078 | 2.170.771 | 0,53 |
| 1.575.000 | WEPA Hygieneprodukte GmbH** | 2,88 % | 15.12.2027 | 1.478.843 | 0,36 |
| 1.760.000 | WMG Acquisition Corp* | 2,25 % | 15.08.2031 | 1.549.145 | 0,38 |
| 1.400.000 | Wp/ap Telecom Holdings III BV** | 5,50 % | 15.01.2030 | 1.281.959 | 0,31 |
| 1.600.000 | ZF Europe Finance BV* | 3,00 % | 23.10.2029 | 1.477.000 | 0,36 |
| 400.000 | ZF Finance GmbH* | 3,00 % | 21.09.2025 | 391.708 | 0,10 |
| 2.500.000 | ZF Finance GmbH* | 3,75 % | 21.09.2028 | 2.418.580 | 0,59 |
| 5.020.000 | Ziggo Bond Co BV* | 3,38 % | 28.02.2030 | 4.255.228 | 1,04 |
| Euro insgesamt | | | | 325.684.785 | 79,74 |
| Britisches Pfund | | | | | |
| 2.775.000 | AA Bond Co Ltd* | 6,50 % | 31.01.2026 | 3.058.325 | 0,75 |
| 500.000 | AA Bond Co Ltd* | 8,45 % | 31.01.2028 | 606.276 | 0,15 |
| 300.000 | Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc* | 4,75 % | 15.07.2027 | 253.410 | 0,06 |
| 500.000 | B&M European Value Retail SA* | 4,00 % | 15.11.2028 | 539.100 | 0,13 |
| 1.414.000 | B&M European Value Retail SA* | 8,13 % | 15.11.2030 | 1.741.742 | 0,43 |
| 5.750.000 | Bellis Acquisition Co Plc** | 3,25 % | 16.02.2026 | 6.174.205 | 1,51 |
| 200.000 | Bellis Finco Plc** | 4,00 % | 16.02.2027 | 201.507 | 0,05 |
| 2.734.000 | British Telecommunications Plc* | 8,38 % | 20.12.2083 | 3.339.442 | 0,82 |
| 800.000 | Castle UK Finco Plc** | 7,00 % | 15.05.2029 | 786.647 | 0,19 |
| 2.295.000 | Constellation Automotive Financing Plc* | 4,88 % | 15.07.2027 | 2.185.328 | 0,54 |
| 2.790.000 | Co-operative Group Holdings 2011 Ltd* | 7,50 % | 08.07.2026 | 3.184.313 | 0,78 |
| 2.440.000 | CPUK Finance Ltd** | 6,50 % | 28.08.2026 | 2.729.169 | 0,67 |
| 500.000 | Ford Motor Credit Co LLC* | 4,54 % | 06.03.2025 | 569.077 | 0,14 |
| 1.485.000 | Iceland Bondco Plc** | 10,88 % | 15.12.2027 | 1.792.881 | 0,44 |
| 2.220.000 | Iron Mountain UK Plc* | 3,88 % | 15.11.2025 | 2.473.947 | 0,61 |
| 1.952.000 | Maison Finco Plc** | 6,00 % | 31.10.2027 | 1.953.063 | 0,48 |
| 3.950.000 | Mobico Group Plc* | 4,25 % | 29.12.2049 | 4.036.062 | 0,99 |
| 1.295.000 | MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp* | 2,50 % | 24.03.2026 | 1.218.800 | 0,30 |

European High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert EUR | % des Nettöver- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 94,13 % (31. Dezember 2022: 98,80 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Britisches Pfund (Fortsetzung) | | | | | |
| 2.255.000 | NGG Finance Plc* | 5,63 % | 18.06.2073 | 2.572.467 | 0,63 |
| 2.430.000 | Pinewood Finance Co Ltd** | 3,25 % | 30.09.2025 | 2.733.408 | 0,67 |
| 2.869.000 | Pinnacle Bidco Plc* | 10,00 % | 11.10.2028 | 3.450.568 | 0,84 |
| 2.060.000 | RAC Bond Co Plc** | 5,25 % | 04.11.2027 | 2.085.568 | 0,51 |
| 886.000 | Sherwood Financing Plc** | 6,00 % | 15.11.2026 | 918.690 | 0,22 |
| 965.000 | Stonegate Pub Co Financing 2019 Plc** | 8,25 % | 31.07.2025 | 1.091.445 | 0,27 |
| 450.000 | Travis Perkins Plc* | 3,75 % | 17.02.2026 | 490.185 | 0,12 |
| 1.746.000 | TVL Finance Plc* | 10,25 % | 28.04.2028 | 2.099.398 | 0,51 |
| 1.000.000 | Virgin Media Secured Finance Plc* | 4,25 % | 15.01.2030 | 1.012.078 | 0,25 |
| 1.650.000 | Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC** | 4,88 % | 15.07.2028 | 1.757.874 | 0,43 |
| 1.000.000 | Vmed O2 UK Financing I Plc** | 4,50 % | 15.07.2031 | 1.001.105 | 0,25 |
| 200.000 | Vodafone Group Plc* | 4,88 % | 03.10.2078 | 224.905 | 0,05 |
| 2.620.000 | Zenith Finco Plc** | 6,50 % | 30.06.2027 | 2.467.966 | 0,60 |
| Britisches Pfund insgesamt | | | | 58.748.951 | 14,39 |
| Unternehmensanleihen insgesamt | | | | 384.433.736 | 94,13 |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen 0,03 % (31. Dezember 2022: 0,63 %) | | | | | |
| Euro | | | | | |
| 24.107 | Aernnova Aerospace SAU | 6,92 % | 26.02.2027 | 23.414 | 0,01 |
| 94.016 | Aernnova Aerospace SAU | 6,96 % | 26.02.2027 | 91.313 | 0,02 |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen insgesamt † | | | | 114.727 | 0,03 |
| Anlagen insgesamt | | | | 386.973.804 | 94,75 |

Devisenterminkontrakte 0,15 % (31. Dezember 2022: 3,87 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeits- datum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn EUR | % des Nettöver- mögens |
|---|------------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------|-------------------------------------|------------------------------|
| 5.637.173 € | 4.848.096 £ | 18.01.2024 | UBS AG | 3 | 45.315 | 0,01 |
| 278.715 € | 295.155 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | 11.688 | 0,00 |
| 141.886 € | 122.899 £ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 132 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> | | | | | | |
| 56.000 CHF | 58.593 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 1.701 | 0,00 |
| 1.684.836 CHF | 1.777.778 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 8 | 36.230 | 0,01 |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i> | | | | | | |
| 576 € | 611 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | 23 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen USD</i> | | | | | | |
| 78.829 € | 83.796 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 3.018 | 0,00 |
| 14.840.068 € | 15.806.873 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | 539.581 | 0,13 |
| 142.284 € | 151.595 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 6 | 5.135 | 0,00 |
| 123.627 US\$ | 111.578 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | 268 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | 643.091 | 0,15 |

European High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Total Return Swap-Kontrakte 0,01 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)

| Nominalwert | Datum der Schließung | Variabler Zinssatz | Referenzunternehmen | Nicht realisierter Gewinn EUR | % des Nettovermögens | |
|--|----------------------|--------------------|---------------------|--|----------------------|------|
| EUR | 10.018.326 | 20.03.2024 | 3,90 ¹ | iBoxx EUR Liquid High Yield Index ² | 18.355 | 0,01 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Total Return Swap-Kontrakten [∞] | | | | 18.355 | 0,01 | |

¹ Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist der 6-Monats-EURIBOR.

² Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist Goldman Sachs International.

| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | Zeitwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|--------------------|----------------------|
| | 387.635.250 | 94,91 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,31 %) (31. Dezember 2022: (9,59 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust EUR | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 36.318.532 € | 31.552.201 £ | 18.01.2024 | UBS AG | 8 | (74.191) | (0,02) |
| 15.726.139 € | 13.714.262 £ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 7 | (92.073) | (0,02) |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> | | | | | | |
| 21.500 CHF | 23.169 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (20) | (0,00) |
| 10.072 € | 9.528 CHF | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 4 | (187) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen USD</i> | | | | | | |
| 944.119 US\$ | 873.968 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 9 | (19.823) | (0,00) |
| 27.586.576 US\$ | 25.897.601 € | 18.01.2024 | UBS AG | 3 | (940.007) | (0,23) |
| 8.107.228 US\$ | 7.489.766 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 13 | (155.151) | (0,04) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | (1.281.452) | (0,31) |

| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | Zeitwert EUR | % des Nettovermögens |
|--|--------------------|----------------------|
| | (1.281.452) | (0,31) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | 386.353.798 | 94,60 |
| Sonstiges Nettovermögen | 22.062.519 | 5,40 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | 408.416.317 | 100,00 |

| Portfolioanalyse | EUR | % des Gesamtvermögens |
|---|--------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 267.372.886 | 65,07 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 119.486.191 | 29,08 |
| † Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente | 114.727 | 0,03 |
| [∞] OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente | (620.006) | (0,15) |
| Anlagen insgesamt | 386.353.798 | 94,03 |

European Sustainable Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert EUR | % des Netto- vermögens |
|--|---------------------------------|-------------------|------------------------------|
| Aktien 99,49 % (31. Dezember 2022: 99,17 %) | | | |
| Dänische Krone | | | |
| 97.822 | Netcompany Group A/S | 2.960.420 | 1,72 |
| 112.354 | Novo Nordisk A/S Class B | 10.521.650 | 6,11 |
| Dänische Krone insgesamt | | 13.482.070 | 7,83 |
| Euro | | | |
| 3.848 | Adyen NV | 4.489.077 | 2,61 |
| 59.995 | Alfen NV | 3.616.499 | 2,10 |
| 15.627 | ASML Holding NV | 10.652.926 | 6,19 |
| 28.102 | Beiersdorf AG | 3.813.441 | 2,22 |
| 13.093 | DiaSorin SpA | 1.220.791 | 0,71 |
| 26.711 | EssilorLuxottica SA | 4.850.718 | 2,82 |
| 97.285 | Euronext NV | 7.651.465 | 4,45 |
| 7.132 | Ferrari NV | 2.176.686 | 1,26 |
| 137.963 | HelloFresh SE | 1.974.250 | 1,15 |
| 15.435 | Kering SA | 6.158.565 | 3,58 |
| 17.823 | L'Oreal SA | 8.031.935 | 4,67 |
| 168.880 | RELX Plc | 6.049.282 | 3,51 |
| 26.481 | Reply SpA | 3.164.479 | 1,84 |
| 10.826 | Sartorius Stedim Biotech | 2.592.827 | 1,51 |
| 52.255 | Schneider Electric SE | 9.498.914 | 5,52 |
| 63.993 | Scout24 SE | 4.105.791 | 2,38 |
| 114.400 | TeamViewer SE | 1.608.464 | 0,93 |
| 132.644 | Zalando SE | 2.845.214 | 1,65 |
| Euro insgesamt | | 84.501.324 | 49,10 |
| Norwegische Krone | | | |
| 109.904 | Bakkafrost P/F | 5.211.834 | 3,03 |
| Norwegische Krone insgesamt | | 5.211.834 | 3,03 |
| Britisches Pfund | | | |
| 367.495 | 3i Group Plc | 10.267.473 | 5,97 |
| 297.157 | CVS Group Plc | 5.771.483 | 3,35 |
| 77.173 | London Stock Exchange Group Plc | 8.259.425 | 4,80 |
| Britisches Pfund insgesamt | | 24.298.381 | 14,12 |
| Schwedische Krone | | | |
| 248.717 | Assa Abloy AB Class B | 6.485.746 | 3,77 |
| 257.416 | Atlas Copco AB Class A | 4.012.985 | 2,33 |
| Schwedische Krone insgesamt | | 10.498.731 | 6,10 |

European Sustainable Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert EUR | % des Nettover- mögens |
|---|------------------------------------|--------------------|--|
| Aktien 99,49 % (31. Dezember 2022: 99,17 %) (Fortsetzung) | | | |
| Schweizer Franken | | | |
| 85.327 | Nestle SA | 8.949.101 | 5,20 |
| 5.949 | Partners Group Holding AG | 7.761.551 | 4,51 |
| 36.320 | Straumann Holding AG | 5.297.236 | 3,08 |
| 10.797 | Tecan Group AG | 3.987.926 | 2,32 |
| 11.135 | VAT Group AG | 5.048.142 | 2,93 |
| | Schweizer Franken insgesamt | 31.043.956 | 18,04 |
| US-Dollar | | | |
| 25.840 | SolarEdge Technologies Inc | 2.189.494 | 1,27 |
| | US-Dollar insgesamt | 2.189.494 | 1,27 |
| | Aktien insgesamt * | 171.225.790 | 99,49 |
| | Anlagen insgesamt | 171.225.790 | 99,49 |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | | 171.225.790 | 99,49 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | | 171.225.790 | 99,49 |
| Sonstiges Nettovermögen | | 871.761 | 0,51 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | | 172.097.551 | 100,00 |
| Portfolioanalyse | | EUR | % des Gesamtver- mögens |
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | | 171.225.790 | 98,69 |
| Anlagen insgesamt | | 171.225.790 | 98,69 |

Event Driven - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|---|-----------------------------|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| Schatzwechsel 91,00 % (31. Dezember 2022: 81,61 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 7.000.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 04.01.2024 | 6.997.968 | 5,54 |
| 3.000.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 09.01.2024 | 2.996.944 | 2,37 |
| 7.000.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 11.01.2024 | 6.990.862 | 5,53 |
| 3.000.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 16.01.2024 | 2.993.872 | 2,37 |
| 7.000.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 18.01.2024 | 6.983.585 | 5,52 |
| 7.000.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 25.01.2024 | 6.976.441 | 5,52 |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 01.02.2024 | 4.978.049 | 3,94 |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 08.02.2024 | 4.972.947 | 3,93 |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 15.02.2024 | 4.968.002 | 3,93 |
| 6.000.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 22.02.2024 | 5.955.440 | 4,71 |
| 6.000.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 29.02.2024 | 5.949.161 | 4,71 |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 07.03.2024 | 4.953.044 | 3,92 |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 14.03.2024 | 4.948.165 | 3,91 |
| 6.000.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 19.03.2024 | 5.933.334 | 4,69 |
| 6.000.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 21.03.2024 | 5.931.708 | 4,69 |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 28.03.2024 | 4.937.987 | 3,91 |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 04.04.2024 | 4.932.898 | 3,90 |
| 7.000.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 11.04.2024 | 6.899.258 | 5,46 |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 16.04.2024 | 4.924.118 | 3,90 |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 23.04.2024 | 4.919.215 | 3,89 |
| 6.000.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 30.04.2024 | 5.896.721 | 4,66 |
| Schatzwechsel insgesamt ** | | | | 115.039.719 | 91,00 |
| Anlagen insgesamt | | | | 115.039.719 | 91,00 |

Devisenterminkontrakte 3,21 % (31. Dezember 2022: 2,21 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeits- datum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|------------------------|-----------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 9.462 € | 10.078 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 4 | 380 | 0,00 |
| 307 € | 336 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | 3 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 79.786.994 £ | 97.968.962 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 2 | 3.752.417 | 2,97 |
| 16.000.327 £ | 20.099.048 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 62 | 299.957 | 0,24 |
| 4.596.271 US\$ | 3.601.100 £ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | 5.186 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | 4.057.943 | 3,21 |

Event Driven - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Total Return Swap-Kontrakte 0,76 % (31. Dezember 2022: 0,04 %)

| | Nominalwert | Datum der Schließung | Variabler Zinssatz | Referenzunternehmen | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|-------------|----------------------|--------------------|--|--------------------------------|----------------------|
| USD | 103.060.180 | 28.10.2024 | 0,25 ¹ | Alphas Managed Accounts Platform CXIV Limited ² | 959.529 | 0,76 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Total Return Swap-Kontrakten [∞] | | | | | 959.529 | 0,76 |

¹ Fester Zinssatz.

² Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist Morgan Stanley.

| | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|--------------------|----------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 120.057.191 | 94,97 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,12 %) (31. Dezember 2022: (0,04 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 237 US\$ | 219 € | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 2 | (6) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 216.997 £ | 276.907 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | (255) | (0,00) |
| 5.179.066 US\$ | 4.183.952 £ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 34 | (155.104) | (0,12) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | (155.365) | (0,12) |

| | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|---|--------------------|----------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (155.365) | (0,12) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | 119.901.826 | 94,85 |
| Sonstiges Nettovermögen | 6.510.322 | 5,15 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | 126.412.148 | 100,00 |

| Portfolioanalyse | US\$ | % des Gesamtvermögens |
|--|--------------------|-----------------------|
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 115.039.719 | 85,84 |
| [∞] OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente | 4.862.107 | 3,63 |
| Anlagen insgesamt | 119.901.826 | 89,47 |

Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|---|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Agency Bonds 1,05 % (31. Dezember 2022: 1,80 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 395.000 | Federal Home Loan Banks* | 5,50 % | 15.07.2036 | 446.745 | 0,41 |
| 185.000 | Federal National Mortgage Association** | 0,50 % | 07.11.2025 | 172.350 | 0,16 |
| 165.000 | Federal National Mortgage Association** | 0,75 % | 08.10.2027 | 146.541 | 0,13 |
| 390.000 | Federal National Mortgage Association** | 0,88 % | 05.08.2030 | 318.020 | 0,29 |
| 55.000 | Tennessee Valley Authority* | 5,88 % | 01.04.2036 | 62.882 | 0,06 |
| Agency Bonds insgesamt | | | | 1.146.538 | 1,05 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 9,99 % (31. Dezember 2022: 6,57 %) | | | | | |
| Euro | | | | | |
| 580.425 | Clavel Residential 3 DAC Series 2023-1X Class A | 5,33 % | 28.01.2076 | 637.913 | 0,59 |
| 88.190 | Dutch Property Finance BV Series 2022-2 Class A | 4,83 % | 28.04.2062 | 97.398 | 0,09 |
| 105.949 | European Residential Loan Securitisation 2019-NPL2 DAC Class A | 6,88 % | 24.02.2058 | 116.248 | 0,11 |
| 399.918 | Last Mile Securities - PE 2021 DAC Series 2021-1X Class A2 | 5,04 % | 17.08.2031 | 430.110 | 0,39 |
| 182.575 | Primrose Residential 2021-1 DAC Series 2021-1 Class A | 4,61 % | 24.03.2061 | 201.804 | 0,18 |
| 94.104 | Red & Black Auto Italy SRL | 4,87 % | 28.07.2034 | 104.394 | 0,10 |
| 600.000 | Shamrock Residential 2022-1 DAC Series 2022-1 Class C | 5,76 % | 24.01.2061 | 647.933 | 0,60 |
| 278.389 | Shamrock Residential 2023-1 DAC Series 2023-1X Class A | 4,86 % | 24.06.2071 | 306.842 | 0,28 |
| 400.000 | Stresa Securitisation SRL | 5,17 % | 22.12.2045 | 428.392 | 0,39 |
| Euro insgesamt | | | | 2.971.034 | 2,73 |
| Britisches Pfund | | | | | |
| 120.000 | Mortimer BTL 2021-1 Plc Series 2021-1 Class C | 6,67 % | 23.06.2053 | 149.363 | 0,14 |
| 407.071 | Parkmore Point RMBS 2022-1 Plc Series 2022-1X Class A | 6,72 % | 25.07.2045 | 520.663 | 0,48 |
| Britisches Pfund insgesamt | | | | 670.026 | 0,62 |
| US-Dollar | | | | | |
| 865.496 | CD 2017-CD6 Mortgage Trust Class ASB | 3,33 % | 13.11.2050 | 834.028 | 0,77 |
| 975.026 | Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC27 Class XA | 1,30 % | 10.02.2048 | 8.840 | 0,01 |
| 305.000 | COMM 2014-CCRE15 Mortgage Trust Class AM | 4,43 % | 10.02.2047 | 297.245 | 0,27 |
| 1.614.731 | COMM 2014-CCRE17 Mortgage Trust Class XA | 0,87 % | 10.05.2047 | 221 | 0,00 |
| 896.744 | COMM 2014-LC15 Mortgage Trust Class XA | 0,00 % | 10.04.2047 | 58 | 0,00 |
| 1.523.497 | COMM 2014-UBS3 Mortgage Trust Class XA | 1,04 % | 10.06.2047 | 321 | 0,00 |
| 586.000 | Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R01 Class 1M2 | 7,24 % | 25.12.2041 | 587.831 | 0,54 |
| 2.323.044 | CSAIL 2015-C2 Commercial Mortgage Trust Class XA | 0,71 % | 15.06.2057 | 13.250 | 0,01 |
| 505.000 | CSAIL 2018-CX12 Commercial Mortgage Trust Class A4 | 4,22 % | 15.08.2051 | 480.760 | 0,44 |
| 207.364 | Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 2M2 | 9,80 % | 25.05.2029 | 218.858 | 0,20 |
| 522.591 | Fannie Mae REMICS Class HS | 0,55 % | 25.07.2042 | 69.593 | 0,06 |
| 331.166 | Fannie Mae REMICS Class PI | 3,50 % | 25.12.2042 | 51.541 | 0,05 |
| 591.284 | Fannie Mae REMICS Class SA | 0,40 % | 25.07.2046 | 67.693 | 0,06 |

Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|---|---|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 9,99 % (31. Dezember 2022: 6,57 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 570.456 | Freddie Mac REMICS Class HS | 1,00 % | 15.03.2042 | 78.028 | 0,07 |
| 561.799 | Freddie Mac REMICS Class SA | 0,60 % | 15.04.2046 | 68.219 | 0,06 |
| 545.000 | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA1 Class M2 | 7,84 % | 25.01.2042 | 545.065 | 0,50 |
| 550.000 | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA3 Class M1B | 8,24 % | 25.04.2042 | 565.832 | 0,52 |
| 578.180 | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-HQA1 Class M1A | 7,44 % | 25.03.2042 | 582.806 | 0,54 |
| 550.000 | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-HQA1 Class M1B | 8,84 % | 25.03.2042 | 570.448 | 0,52 |
| 357.622 | Freddie Mac Strips Class S1 | 0,50 % | 15.09.2043 | 43.411 | 0,04 |
| 446.765 | Government National Mortgage Association Class AB | 1,00 % | 20.07.2050 | 342.633 | 0,32 |
| 951.856 | Government National Mortgage Association Class AI | 2,00 % | 20.02.2051 | 113.793 | 0,10 |
| 335.968 | Government National Mortgage Association Class HE | 2,00 % | 20.06.2051 | 278.999 | 0,26 |
| 482.373 | Government National Mortgage Association Class IT | 3,50 % | 20.02.2043 | 70.732 | 0,07 |
| 362.044 | Government National Mortgage Association Class KA | 1,00 % | 20.08.2050 | 277.281 | 0,26 |
| 319.128 | Government National Mortgage Association Class NC | 1,50 % | 20.07.2051 | 261.168 | 0,24 |
| 317.466 | Government National Mortgage Association Class WK | 1,00 % | 20.06.2050 | 243.144 | 0,22 |
| 112.214 | GS Mortgage Securities Trust 2014-GC18 Class XA | 0,81 % | 10.01.2047 | 6 | 0,00 |
| 2.520.327 | GS Mortgage Securities Trust 2015-GC30 Class XA | 0,72 % | 10.05.2050 | 17.508 | 0,02 |
| 109.000 | JP Morgan Mortgage Trust 2023-HE3 Class A1 | 6,94 % | 25.05.2054 | 109.273 | 0,10 |
| 160.000 | Morgan Stanley Capital I Trust 2017-H1 Class C | 4,28 % | 15.06.2050 | 133.722 | 0,12 |
| 286.875 | Taco Bell Funding LLC Class A23 | 4,97 % | 25.05.2046 | 283.402 | 0,26 |
| 1.607.947 | WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C21 Class XA | 0,98 % | 15.08.2047 | 7.737 | 0,01 |
| US-Dollar insgesamt | | | | 7.223.446 | 6,64 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt ** | | | | 10.864.506 | 9,99 |
| Unternehmensanleihen 26,54 % (31. Dezember 2022: 32,90 %) | | | | | |
| Dänische Krone | | | | | |
| 7.028.062 | Nykredit Realkredit AS* | 4,00 % | 01.10.2053 | 1.030.253 | 0,95 |
| Dänische Krone insgesamt | | | | 1.030.253 | 0,95 |
| Euro | | | | | |
| 100.000 | American Tower Corp* | 4,13 % | 16.05.2027 | 112.923 | 0,10 |
| 135.000 | AT&T Inc* | 2,40 % | 15.03.2024 | 148.623 | 0,14 |
| 100.000 | AT&T Inc* | 2,45 % | 15.03.2035 | 98.559 | 0,09 |
| 306.000 | Athene Global Funding* | 0,37 % | 10.09.2026 | 309.829 | 0,28 |
| 130.000 | Australia & New Zealand Banking Group Ltd* | 5,10 % | 03.02.2033 | 147.815 | 0,14 |
| 100.000 | Bayerische Landesbank* | 7,00 % | 05.01.2034 | 114.630 | 0,10 |
| 200.000 | BNP Paribas Home Loan SFH SA* | 3,00 % | 25.05.2028 | 223.834 | 0,21 |
| 100.000 | BPCE SA* | 5,75 % | 01.06.2033 | 116.933 | 0,11 |
| 200.000 | BPCE SFH SA* | 3,25 % | 12.04.2028 | 225.043 | 0,21 |
| 100.000 | BUPA Finance Plc* | 5,00 % | 12.10.2030 | 118.891 | 0,11 |

Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 26,54 % (31. Dezember 2022: 32,90 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Euro (Fortsetzung) | | | | | |
| 300.000 | Canadian Imperial Bank of Commerce* | 3,25 % | 31.03.2027 | 334.503 | 0,31 |
| 200.000 | Carmila SA* | 5,50 % | 09.10.2028 | 229.326 | 0,21 |
| 307.000 | Digital Dutch Finco BV* | 1,00 % | 15.01.2032 | 270.729 | 0,25 |
| 135.000 | Exxon Mobil Corp* | 1,41 % | 26.06.2039 | 110.859 | 0,10 |
| 200.000 | Federation des Caisses Desjardins du Quebec* | 3,25 % | 18.04.2028 | 223.925 | 0,21 |
| 195.000 | Global Payments Inc* | 4,88 % | 17.03.2031 | 226.685 | 0,21 |
| 210.000 | Heimstaden Bostad Treasury BV* | 0,63 % | 24.07.2025 | 206.204 | 0,19 |
| 150.000 | Heimstaden Bostad Treasury BV* | 1,38 % | 24.07.2028 | 119.401 | 0,11 |
| 100.000 | Imerys SA* | 4,75 % | 29.11.2029 | 112.361 | 0,10 |
| 100.000 | JPMorgan Chase & Co* | 4,46 % | 13.11.2031 | 116.541 | 0,11 |
| 100.000 | Linde Plc* | 3,63 % | 12.06.2034 | 115.899 | 0,11 |
| 100.000 | Medtronic Global Holdings SCA* | 1,38 % | 15.10.2040 | 81.322 | 0,07 |
| 145.000 | Metropolitan Life Global Funding I* | 4,00 % | 05.04.2028 | 165.405 | 0,15 |
| 150.000 | Molson Coors Beverage Co* | 1,25 % | 15.07.2024 | 163.256 | 0,15 |
| 185.000 | Morgan Stanley* | 5,15 % | 25.01.2034 | 225.049 | 0,21 |
| 100.000 | National Grid North America Inc* | 4,67 % | 12.09.2033 | 118.084 | 0,11 |
| 153.000 | Nordea Bank Abp* | 0,63 % | 18.08.2031 | 155.512 | 0,14 |
| 100.000 | RWE AG* | 4,13 % | 13.02.2035 | 115.011 | 0,10 |
| 100.000 | Sandoz Finance BV* | 4,50 % | 17.11.2033 | 117.380 | 0,11 |
| 400.000 | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd* | 4,09 % | 19.04.2028 | 457.992 | 0,42 |
| 100.000 | Thames Water Utilities Finance Plc* | 4,38 % | 18.01.2031 | 104.783 | 0,10 |
| 380.000 | UBS Group AG* | 4,38 % | 11.01.2031 | 434.023 | 0,40 |
| 100.000 | Upjohn Finance BV* | 1,91 % | 23.06.2032 | 93.220 | 0,08 |
| 100.000 | Vonovia SE* | 0,75 % | 01.09.2032 | 84.102 | 0,08 |
| 200.000 | Westpac Securities NZ Ltd* | 3,75 % | 20.04.2028 | 227.708 | 0,21 |
| Euro insgesamt | | | | 6.226.360 | 5,73 |
| Britisches Pfund | | | | | |
| 60.000 | Anglo American Capital Plc* | 3,38 % | 11.03.2029 | 70.644 | 0,07 |
| 113.000 | Barclays Plc* | 7,09 % | 06.11.2029 | 153.576 | 0,14 |
| 100.000 | BNP Paribas SA* | 5,75 % | 13.06.2032 | 134.696 | 0,12 |
| 100.000 | British Telecommunications Plc* | 5,75 % | 13.02.2041 | 131.791 | 0,12 |
| 200.000 | Coventry Building Society* | 7,00 % | 07.11.2027 | 265.679 | 0,24 |
| 200.000 | ING Groep NV* | 6,25 % | 20.05.2033 | 257.227 | 0,24 |
| 100.000 | Lloyds Banking Group Plc* | 6,63 % | 02.06.2033 | 130.410 | 0,12 |
| 100.000 | Orsted AS* | 5,13 % | 13.09.2034 | 127.152 | 0,12 |
| 200.000 | Pension Insurance Corp Plc* | 8,00 % | 13.11.2033 | 273.623 | 0,25 |
| 100.000 | Volkswagen Financial Services NV* | 6,50 % | 18.09.2027 | 133.353 | 0,12 |
| Britisches Pfund insgesamt | | | | 1.678.151 | 1,54 |

Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 26,54 % (31. Dezember 2022: 32,90 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 610.000 | AbbVie Inc* | 2,95 % | 21.11.2026 | 585.113 | 0,54 |
| 58.000 | AbbVie Inc* | 4,05 % | 21.11.2039 | 52.402 | 0,05 |
| 130.000 | American Express Co** | 6,49 % | 30.10.2031 | 141.055 | 0,13 |
| 225.000 | Amgen Inc** | 5,75 % | 02.03.2063 | 236.340 | 0,22 |
| 141.000 | Analog Devices Inc** | 2,10 % | 01.10.2031 | 120.071 | 0,11 |
| 180.000 | Anheuser-Busch Cos LLC/Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc* | 4,70 % | 01.02.2036 | 179.515 | 0,17 |
| 225.000 | Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc* | 5,45 % | 23.01.2039 | 237.457 | 0,22 |
| 110.000 | Apple Inc** | 3,35 % | 09.02.2027 | 107.218 | 0,10 |
| 425.000 | Asian Development Bank* | 4,50 % | 25.08.2028 | 433.791 | 0,40 |
| 370.000 | AT&T Inc** | 3,50 % | 15.09.2053 | 268.816 | 0,25 |
| 200.000 | Banco Santander SA* | 6,92 % | 08.08.2033 | 213.337 | 0,20 |
| 210.000 | Bank of America Corp** | 1,84 % | 04.02.2025 | 209.198 | 0,19 |
| 440.000 | Bank of America Corp** | 1,92 % | 24.10.2031 | 357.445 | 0,33 |
| 175.000 | Bank of America Corp** | 2,30 % | 21.07.2032 | 142.962 | 0,13 |
| 189.000 | Boeing Co* | 5,04 % | 01.05.2027 | 190.751 | 0,18 |
| 65.000 | Boeing Co* | 5,71 % | 01.05.2040 | 67.273 | 0,06 |
| 315.000 | Boeing Co* | 5,81 % | 01.05.2050 | 326.419 | 0,30 |
| 130.000 | BP Capital Markets America Inc* | 4,81 % | 13.02.2033 | 131.126 | 0,12 |
| 27.000 | Broadcom Inc** | 3,15 % | 15.11.2025 | 26.161 | 0,02 |
| 95.000 | Capital One Financial Corp** | 7,62 % | 30.10.2031 | 104.484 | 0,10 |
| 220.000 | CDW LLC/CDW Finance Corp** | 2,67 % | 01.12.2026 | 206.039 | 0,19 |
| 185.000 | CDW LLC/CDW Finance Corp** | 4,25 % | 01.04.2028 | 177.333 | 0,16 |
| 215.000 | Charles Schwab Corp** | 6,14 % | 24.08.2034 | 226.709 | 0,21 |
| 250.000 | Citigroup Inc** | 3,35 % | 24.04.2025 | 248.142 | 0,23 |
| 100.000 | Citigroup Inc** | 3,89 % | 10.01.2028 | 96.755 | 0,09 |
| 125.000 | Comcast Corp** | 2,35 % | 15.01.2027 | 117.393 | 0,11 |
| 260.000 | Comcast Corp** | 5,35 % | 15.05.2053 | 269.177 | 0,25 |
| 100.000 | ConocoPhillips Co* | 5,55 % | 15.03.2054 | 106.266 | 0,10 |
| 305.000 | Constellation Brands Inc* | 4,90 % | 01.05.2033 | 307.045 | 0,28 |
| 210.000 | Corebridge Financial Inc* | 5,75 % | 15.01.2034 | 214.813 | 0,20 |
| 395.000 | Corp Andina de Fomento* | 2,25 % | 08.02.2027 | 362.027 | 0,33 |
| 200.000 | Corp Nacional del Cobre de Chile* | 5,95 % | 08.01.2034 | 203.274 | 0,19 |
| 65.000 | Crown Castle Inc* | 1,05 % | 15.07.2026 | 58.680 | 0,05 |
| 130.000 | CVS Health Corp* | 3,00 % | 15.08.2026 | 124.272 | 0,11 |
| 145.000 | CVS Health Corp* | 4,78 % | 25.03.2038 | 137.462 | 0,13 |
| 230.000 | CVS Health Corp* | 5,30 % | 01.06.2033 | 236.127 | 0,22 |
| 115.000 | DTE Energy Co* | 1,05 % | 01.06.2025 | 108.460 | 0,10 |
| 50.000 | Evergy Inc** | 2,45 % | 15.09.2024 | 48.889 | 0,04 |
| 310.000 | Exelon Corp** | 5,30 % | 15.03.2033 | 316.626 | 0,29 |

Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 26,54 % (31. Dezember 2022: 32,90 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 130.000 | Exxon Mobil Corp [*] | 3,10 % | 16.08.2049 | 96.601 | 0,09 |
| 255.000 | Fifth Third Bancorp ^{**} | 4,34 % | 25.04.2033 | 237.218 | 0,22 |
| 150.000 | General Motors Co [*] | 6,80 % | 01.10.2027 | 159.107 | 0,15 |
| 410.000 | Goldman Sachs Group Inc ^{**} | 1,76 % | 24.01.2025 | 408.589 | 0,38 |
| 370.000 | Goldman Sachs Group Inc ^{**} | 3,27 % | 29.09.2025 | 363.785 | 0,33 |
| 60.000 | Ingersoll Rand Inc [*] | 5,40 % | 14.08.2028 | 61.868 | 0,06 |
| 60.000 | Ingersoll Rand Inc [*] | 5,70 % | 14.08.2033 | 63.509 | 0,06 |
| 180.000 | Intel Corp ^{**} | 5,70 % | 10.02.2053 | 194.787 | 0,18 |
| 130.000 | Intel Corp ^{**} | 5,90 % | 10.02.2063 | 145.071 | 0,13 |
| 825.000 | Inter-American Development Bank [†] | 1,13 % | 13.01.2031 | 680.333 | 0,63 |
| 195.000 | Inter-American Development Bank [†] | 4,50 % | 15.05.2026 | 196.281 | 0,18 |
| 235.000 | Inter-American Development Bank [†] | 4,50 % | 13.09.2033 | 242.608 | 0,22 |
| 85.000 | Interstate Power & Light Co ^{**} | 2,30 % | 01.06.2030 | 72.824 | 0,07 |
| 655.000 | JPMorgan Chase & Co ^{**} | 3,22 % | 01.03.2025 | 652.386 | 0,60 |
| 190.000 | JPMorgan Chase & Co ^{**} | 6,25 % | 23.10.2034 | 206.068 | 0,19 |
| 200.000 | Lloyds Banking Group Plc [*] | 4,98 % | 11.08.2033 | 194.939 | 0,18 |
| 445.000 | Marathon Petroleum Corp ^{**} | 4,70 % | 01.05.2025 | 442.351 | 0,41 |
| 65.000 | Marvell Technology Inc ^{**} | 2,95 % | 15.04.2031 | 56.833 | 0,05 |
| 175.000 | Marvell Technology Inc ^{**} | 5,95 % | 15.09.2033 | 185.705 | 0,17 |
| 330.000 | McDonald's Corp [*] | 5,45 % | 14.08.2053 | 351.449 | 0,32 |
| 50.000 | Merck & Co Inc [*] | 3,90 % | 07.03.2039 | 45.507 | 0,04 |
| 120.000 | Mohawk Industries Inc [*] | 5,85 % | 18.09.2028 | 124.502 | 0,11 |
| 350.000 | Molson Coors Beverage Co [*] | 4,20 % | 15.07.2046 | 298.754 | 0,27 |
| 150.000 | Morgan Stanley ^{**} | 2,72 % | 22.07.2025 | 147.545 | 0,14 |
| 170.000 | Morgan Stanley [*] | 3,63 % | 20.01.2027 | 164.908 | 0,15 |
| 255.000 | Morgan Stanley ^{**} | 5,25 % | 21.04.2034 | 255.094 | 0,23 |
| 210.000 | Morgan Stanley ^{**} | 5,42 % | 21.07.2034 | 213.226 | 0,20 |
| 160.000 | Morgan Stanley ^{**} | 5,95 % | 19.01.2038 | 161.877 | 0,15 |
| 100.000 | NextEra Energy Capital Holdings Inc [*] | 4,90 % | 28.02.2028 | 101.000 | 0,09 |
| 140.000 | NextEra Energy Capital Holdings Inc [*] | 5,25 % | 28.02.2053 | 137.794 | 0,13 |
| 210.000 | NXP BV/NXP Funding LLC/NXP USA Inc ^{**} | 5,00 % | 15.01.2033 | 210.463 | 0,19 |
| 109.000 | Occidental Petroleum Corp [*] | 6,13 % | 01.01.2031 | 113.295 | 0,10 |
| 65.000 | Occidental Petroleum Corp ^{**} | 6,45 % | 15.09.2036 | 68.860 | 0,06 |
| 155.000 | Pacific Gas & Electric Co [*] | 6,95 % | 15.03.2034 | 170.456 | 0,16 |
| 105.000 | Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd [†] | 5,34 % | 19.05.2063 | 106.095 | 0,10 |
| 110.000 | Phillips 66 [*] | 1,30 % | 15.02.2026 | 102.255 | 0,09 |
| 230.000 | Pilgrim's Pride Corp ^{**} | 6,88 % | 15.05.2034 | 248.592 | 0,23 |
| 200.000 | PNC Financial Services Group Inc ^{**} | 6,88 % | 20.10.2034 | 222.112 | 0,20 |
| 235.000 | RTX Corp [*] | 6,40 % | 15.03.2054 | 272.250 | 0,25 |
| 695.000 | SBA Tower Trust [†] | 2,59 % | 15.10.2056 | 560.767 | 0,52 |

Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 26,54 % (31. Dezember 2022: 32,90 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 150.000 | Sempra* | 5,50 % | 01.08.2033 | 155.595 | 0,14 |
| 130.000 | Simon Property Group LP* | 6,25 % | 15.01.2034 | 141.517 | 0,13 |
| 255.000 | Societe Generale SA** | 1,49 % | 14.12.2026 | 234.900 | 0,22 |
| 495.000 | Southern Co* | 5,20 % | 15.06.2033 | 505.317 | 0,46 |
| 150.000 | Southern Co Gas Capital Corp* | 1,75 % | 15.01.2031 | 122.793 | 0,11 |
| 385.000 | Sprint Capital Corp** | 8,75 % | 15.03.2032 | 475.644 | 0,44 |
| 175.000 | T-Mobile USA Inc* | 2,55 % | 15.02.2031 | 150.814 | 0,14 |
| 205.000 | T-Mobile USA Inc** | 3,38 % | 15.04.2029 | 190.699 | 0,18 |
| 65.000 | Travelers Cos Inc* | 5,45 % | 25.05.2053 | 70.204 | 0,06 |
| 200.000 | UBS AG** | 5,65 % | 11.09.2028 | 207.554 | 0,19 |
| 310.000 | UBS Group AG** | 6,54 % | 12.08.2033 | 331.011 | 0,30 |
| 265.000 | Ventas Realty LP* | 3,50 % | 15.04.2024 | 263.026 | 0,24 |
| 130.000 | Verizon Communications Inc* | 5,05 % | 09.05.2033 | 132.686 | 0,12 |
| 180.000 | Vodafone Group Plc** | 4,38 % | 19.02.2043 | 157.118 | 0,14 |
| 405.000 | Warnermedia Holdings Inc** | 5,14 % | 15.03.2052 | 347.873 | 0,32 |
| US-Dollar insgesamt | | | | 19.920.838 | 18,32 |
| Unternehmensanleihen insgesamt | | | | 28.855.602 | 26,54 |
| Staatsanleihen 39,07 % (31. Dezember 2022: 39,81 %) | | | | | |
| Australischer Dollar | | | | | |
| 513.000 | New South Wales Treasury Corp* | 4,25 % | 20.02.2036 | 333.695 | 0,31 |
| 650.000 | New Zealand Local Government Funding Agency Bond** | 5,10 % | 28.11.2030 | 457.721 | 0,42 |
| 519.000 | Queensland Treasury Corp* | 4,50 % | 09.03.2033 | 356.622 | 0,33 |
| 383.000 | Queensland Treasury Corp* | 5,25 % | 21.07.2036 | 274.356 | 0,25 |
| Australischer Dollar insgesamt | | | | 1.422.394 | 1,31 |
| Kanadischer Dollar | | | | | |
| 785.000 | Canadian Government Bond* | 2,00 % | 01.12.2051 | 479.518 | 0,44 |
| 1.261.000 | Canadian Government Bond* | 2,25 % | 01.06.2029 | 917.898 | 0,84 |
| 935.000 | Canadian Government Bond* | 3,25 % | 01.09.2028 | 711.576 | 0,66 |
| 418.000 | City of Toronto Canada** | 4,25 % | 11.07.2033 | 327.057 | 0,30 |
| Kanadischer Dollar insgesamt | | | | 2.436.049 | 2,24 |
| Euro | | | | | |
| 742.000 | Autonomous Community of Madrid Spain* | 3,36 % | 31.10.2028 | 842.813 | 0,77 |
| 1.236.000 | Autonomous Community of Madrid Spain* | 3,60 % | 30.04.2033 | 1.416.897 | 1,30 |
| 604.000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe* | 2,30 % | 15.02.2033 | 684.631 | 0,63 |
| 248.000 | European Union* | 0,40 % | 04.02.2037 | 202.790 | 0,19 |
| 139.000 | European Union* | 0,45 % | 04.07.2041 | 100.691 | 0,09 |
| 260.000 | European Union* | 2,50 % | 04.10.2052 | 255.246 | 0,23 |

Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 39,07 % (31. Dezember 2022: 39,81 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Euro (Fortsetzung) | | | | | |
| 430.000 | European Union* | 3,38 % | 04.10.2038 | 499.325 | 0,46 |
| 1.057.000 | French Republic Government Bond OAT* | 0,75 % | 25.05.2028 | 1.096.472 | 1,01 |
| 1.500.000 | Gemeinsame Deutsche Bundeslaender* | 3,00 % | 26.04.2030 | 1.705.981 | 1,57 |
| 121.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | 1,70 % | 01.09.2051 | 82.297 | 0,08 |
| 218.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | 3,45 % | 01.03.2048 | 215.771 | 0,19 |
| 700.000 | Junta de Castilla y Leon* | 3,50 % | 30.04.2033 | 788.473 | 0,72 |
| 742.000 | Land Baden-Wuerttemberg* | 3,00 % | 27.06.2033 | 851.982 | 0,78 |
| 250.000 | Land Berlin* | 2,88 % | 05.04.2029 | 281.888 | 0,26 |
| 785.000 | Land Berlin* | 3,00 % | 04.05.2028 | 886.986 | 0,82 |
| 905.000 | Land Berlin* | 3,00 % | 11.07.2031 | 1.030.596 | 0,95 |
| 500.000 | Land Thueringen* | 3,00 % | 15.11.2028 | 566.203 | 0,52 |
| 296.000 | Spain Government Bond* | 2,70 % | 31.10.2048 | 281.733 | 0,26 |
| 308.000 | Spain Government Bond* | 3,15 % | 30.04.2033 | 346.270 | 0,32 |
| 517.000 | Spain Government Bond* | 5,15 % | 31.10.2028 | 638.430 | 0,59 |
| 1.300.000 | State of Brandenburg* | 3,00 % | 20.07.2033 | 1.486.697 | 1,37 |
| 2.050.000 | State of Hesse* | 2,88 % | 04.07.2033 | 2.321.554 | 2,13 |
| 462.000 | State of North Rhine-Westphalia Germany* | 3,00 % | 27.01.2028 | 521.346 | 0,48 |
| 450.000 | State of Schleswig-Holstein Germany* | 2,88 % | 10.05.2028 | 505.778 | 0,47 |
| 980.000 | State of Schleswig-Holstein Germany* | 3,00 % | 05.06.2030 | 1.116.192 | 1,03 |
| Euro insgesamt | | | | 18.727.042 | 17,22 |
| Indonesische Rupiah | | | | | |
| 13.629.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 6,38 % | 15.04.2032 | 873.102 | 0,80 |
| 23.773.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 6,63 % | 15.05.2033 | 1.549.483 | 1,43 |
| Indonesische Rupiah insgesamt | | | | 2.422.585 | 2,23 |
| Japanischer Yen | | | | | |
| 152.350.000 | Japan Government Five Year Bond* | 0,01 % | 20.09.2026 | 1.079.425 | 0,99 |
| 120.800.000 | Japan Government Forty Year Bond* | 0,40 % | 20.03.2056 | 585.059 | 0,54 |
| 23.800.000 | Japan Government Forty Year Bond* | 1,00 % | 20.03.2062 | 133.869 | 0,12 |
| 14.800.000 | Japan Government Ten Year Bond* | 0,50 % | 20.03.2033 | 104.202 | 0,10 |
| 163.050.000 | Japan Government Thirty Year Bond* | 0,70 % | 20.12.2048 | 947.901 | 0,87 |
| 13.800.000 | Japan Government Thirty Year Bond* | 1,20 % | 20.06.2053 | 87.506 | 0,08 |
| 76.850.000 | Japan Government Twenty Year Bond* | 0,40 % | 20.03.2039 | 491.634 | 0,45 |
| 139.500.000 | Japan Government Twenty Year Bond* | 0,50 % | 20.09.2041 | 865.770 | 0,80 |
| 37.700.000 | Japan Government Twenty Year Bond* | 1,10 % | 20.03.2043 | 254.999 | 0,24 |
| Japanischer Yen insgesamt | | | | 4.550.365 | 4,19 |
| Mexikanischer Peso | | | | | |
| 15.200.000 | Mexican Bonos* | 7,50 % | 26.05.2033 | 819.455 | 0,75 |
| Mexikanischer Peso insgesamt | | | | 819.455 | 0,75 |

Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 39,07 % (31. Dezember 2022: 39,81 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Neuseeländischer Dollar | | | | | |
| 1.088.000 | New Zealand Government Bond* | 4,25 % | 15.05.2034 | 682.094 | 0,63 |
| Neuseeländischer Dollar insgesamt | | | | 682.094 | 0,63 |
| Polnischer Zloty | | | | | |
| 1.122.000 | Republic of Poland Government Bond* | 6,00 % | 25.10.2033 | 302.813 | 0,28 |
| Polnischer Zloty insgesamt | | | | 302.813 | 0,28 |
| Britisches Pfund | | | | | |
| 915.000 | United Kingdom Gilt* | 0,63 % | 22.10.2050 | 514.195 | 0,47 |
| 93.000 | United Kingdom Gilt* | 1,25 % | 22.10.2041 | 76.775 | 0,07 |
| 538.000 | United Kingdom Gilt* | 1,75 % | 07.09.2037 | 530.074 | 0,49 |
| 425.732 | United Kingdom Gilt* | 3,75 % | 22.10.2053 | 505.065 | 0,46 |
| 596.000 | United Kingdom Gilt* | 4,75 % | 07.12.2030 | 822.364 | 0,76 |
| Britisches Pfund insgesamt | | | | 2.448.473 | 2,25 |
| Südkoreanischer Won | | | | | |
| 524.340.000 | Korea Treasury Bond* | 2,13 % | 10.06.2027 | 393.195 | 0,36 |
| 950.550.000 | Korea Treasury Bond* | 2,38 % | 10.12.2031 | 694.659 | 0,64 |
| 880.110.000 | Korea Treasury Bond* | 2,50 % | 10.03.2052 | 612.467 | 0,56 |
| 937.540.000 | Korea Treasury Bond* | 3,25 % | 10.03.2028 | 729.453 | 0,67 |
| Südkoreanischer Won insgesamt | | | | 2.429.774 | 2,23 |
| Schweizer Franken | | | | | |
| 300.000 | Swiss Confederation Government Bond* | 1,50 % | 26.10.2038 | 399.725 | 0,37 |
| Schweizer Franken insgesamt | | | | 399.725 | 0,37 |
| US-Dollar | | | | | |
| 1.200.000 | Croatia Government International Bond* | 6,00 % | 26.01.2024 | 1.201.409 | 1,10 |
| 300.000 | Indonesia Government International Bond* | 3,55 % | 31.03.2032 | 278.493 | 0,26 |
| 340.000 | International Bank for Reconstruction & Development** | 4,75 % | 14.11.2033 | 359.349 | 0,33 |
| 90.000 | Japan Bank for International Corp* | 4,63 % | 19.07.2028 | 91.273 | 0,08 |
| 200.000 | Mexico Government International Bond* | 4,75 % | 27.04.2032 | 192.969 | 0,18 |
| 300.000 | Panama Government International Bond* | 2,25 % | 29.09.2032 | 219.479 | 0,20 |
| 300.000 | Panama Government International Bond* | 6,85 % | 28.03.2054 | 281.449 | 0,26 |
| 200.000 | Romanian Government International Bond* | 3,00 % | 14.02.2031 | 170.649 | 0,16 |
| 400.000 | Saudi Government International Bond* | 5,00 % | 18.01.2053 | 377.694 | 0,35 |
| 1.320.000 | United States Treasury Note/Bond* | 4,13 % | 15.08.2053 | 1.334.644 | 1,23 |

Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|-----------------------------------|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 39,07 % (31. Dezember 2022: 39,81 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 185.000 | United States Treasury Note/Bond* | 4,38 % | 30.11.2028 | 189.336 | 0,17 |
| 990.000 | United States Treasury Note/Bond* | 4,50 % | 15.11.2033 | 1.039.655 | 0,96 |
| 100.000 | United States Treasury Note/Bond* | 4,88 % | 31.10.2028 | 104.406 | 0,09 |
| US-Dollar insgesamt | | | | 5.840.805 | 5,37 |
| Staatsanleihen insgesamt | | | | 42.481.574 | 39,07 |
| Mortgage-Backed Securities 20,82 % (31. Dezember 2022: 14,14 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 322.649 | Fannie Mae Pool | 2,00 % | 01.02.2051 | 267.026 | 0,25 |
| 141.191 | Fannie Mae Pool | 2,00 % | 01.04.2051 | 115.998 | 0,11 |
| 73.528 | Fannie Mae Pool | 2,00 % | 01.05.2051 | 60.772 | 0,06 |
| 234.183 | Fannie Mae Pool | 2,50 % | 01.08.2050 | 202.151 | 0,19 |
| 121.065 | Fannie Mae Pool | 2,50 % | 01.09.2050 | 103.711 | 0,10 |
| 526.874 | Fannie Mae Pool | 2,50 % | 01.01.2051 | 454.886 | 0,42 |
| 661.249 | Fannie Mae Pool | 2,50 % | 01.05.2051 | 569.051 | 0,52 |
| 722.158 | Fannie Mae Pool | 2,50 % | 01.06.2051 | 615.172 | 0,57 |
| 409.475 | Fannie Mae Pool | 2,50 % | 01.08.2051 | 351.701 | 0,32 |
| 258.663 | Fannie Mae Pool | 2,50 % | 01.09.2051 | 220.502 | 0,20 |
| 315.893 | Fannie Mae Pool | 2,50 % | 01.02.2052 | 269.009 | 0,25 |
| 143.175 | Fannie Mae Pool | 3,00 % | 01.12.2047 | 130.397 | 0,12 |
| 146.032 | Fannie Mae Pool | 3,00 % | 01.11.2048 | 131.576 | 0,12 |
| 152.640 | Fannie Mae Pool | 3,00 % | 01.02.2049 | 139.612 | 0,13 |
| 134.605 | Fannie Mae Pool | 3,00 % | 01.03.2050 | 120.290 | 0,11 |
| 136.510 | Fannie Mae Pool | 3,00 % | 01.04.2050 | 122.359 | 0,11 |
| 149.198 | Fannie Mae Pool | 3,00 % | 01.04.2051 | 132.392 | 0,12 |
| 46.720 | Fannie Mae Pool | 3,50 % | 01.12.2041 | 44.267 | 0,04 |
| 24.230 | Fannie Mae Pool | 3,50 % | 01.04.2042 | 22.953 | 0,02 |
| 28.833 | Fannie Mae Pool | 3,50 % | 01.05.2042 | 27.277 | 0,02 |
| 40.754 | Fannie Mae Pool | 3,50 % | 01.01.2043 | 38.404 | 0,04 |
| 62.711 | Fannie Mae Pool | 3,50 % | 01.12.2044 | 58.648 | 0,05 |
| 49.814 | Fannie Mae Pool | 3,50 % | 01.03.2045 | 46.510 | 0,04 |
| 75.359 | Fannie Mae Pool | 3,50 % | 01.12.2045 | 70.733 | 0,06 |
| 70.052 | Fannie Mae Pool | 3,50 % | 01.05.2046 | 65.405 | 0,06 |
| 22.807 | Fannie Mae Pool | 3,50 % | 01.06.2047 | 21.294 | 0,02 |
| 134.759 | Fannie Mae Pool | 3,50 % | 01.02.2048 | 125.818 | 0,12 |
| 92.959 | Fannie Mae Pool | 3,50 % | 01.08.2051 | 85.758 | 0,08 |
| 55.691 | Fannie Mae Pool | 3,50 % | 01.07.2052 | 51.122 | 0,05 |
| 22.385 | Fannie Mae Pool | 4,00 % | 01.12.2040 | 21.839 | 0,02 |
| 76.723 | Fannie Mae Pool | 4,00 % | 01.12.2041 | 75.192 | 0,07 |
| 32.949 | Fannie Mae Pool | 4,00 % | 01.01.2045 | 31.777 | 0,03 |

Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|-----------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Mortgage-Backed Securities 20,82 % (31. Dezember 2022: 14,14 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 59.344 | Fannie Mae Pool | 4,00 % | 01.02.2045 | 57.253 | 0,05 |
| 129.752 | Fannie Mae Pool | 4,00 % | 01.02.2046 | 125.342 | 0,12 |
| 32.647 | Fannie Mae Pool | 4,00 % | 01.07.2046 | 31.496 | 0,03 |
| 30.569 | Fannie Mae Pool | 4,00 % | 01.03.2047 | 29.482 | 0,03 |
| 37.517 | Fannie Mae Pool | 4,00 % | 01.05.2047 | 36.183 | 0,03 |
| 46.927 | Fannie Mae Pool | 4,00 % | 01.06.2047 | 45.254 | 0,04 |
| 22.173 | Fannie Mae Pool | 4,00 % | 01.10.2047 | 21.279 | 0,02 |
| 25.046 | Fannie Mae Pool | 4,00 % | 01.04.2048 | 24.135 | 0,02 |
| 123.206 | Fannie Mae Pool | 4,00 % | 01.03.2049 | 118.596 | 0,11 |
| 12.691 | Fannie Mae Pool | 4,50 % | 01.03.2036 | 12.536 | 0,01 |
| 62.779 | Fannie Mae Pool | 4,50 % | 01.04.2041 | 62.722 | 0,06 |
| 12.138 | Fannie Mae Pool | 4,50 % | 01.09.2043 | 12.053 | 0,01 |
| 9.735 | Fannie Mae Pool | 4,50 % | 01.12.2043 | 9.666 | 0,01 |
| 22.074 | Fannie Mae Pool | 4,50 % | 01.05.2044 | 21.767 | 0,02 |
| 6.561 | Fannie Mae Pool | 4,50 % | 01.03.2047 | 6.491 | 0,01 |
| 68.984 | Fannie Mae Pool | 4,50 % | 01.07.2047 | 68.262 | 0,06 |
| 73.448 | Fannie Mae Pool | 4,50 % | 01.06.2052 | 71.248 | 0,07 |
| 159.214 | Fannie Mae Pool | 4,50 % | 01.07.2052 | 154.445 | 0,14 |
| 260.110 | Fannie Mae Pool | 4,50 % | 01.08.2052 | 252.319 | 0,23 |
| 9.442 | Fannie Mae Pool | 5,00 % | 01.07.2035 | 9.598 | 0,01 |
| 18.724 | Fannie Mae Pool | 5,00 % | 01.06.2038 | 19.034 | 0,02 |
| 27.259 | Fannie Mae Pool | 5,00 % | 01.07.2039 | 27.711 | 0,03 |
| 24.297 | Fannie Mae Pool | 5,00 % | 01.09.2040 | 24.700 | 0,02 |
| 27.845 | Fannie Mae Pool | 5,00 % | 01.02.2041 | 28.272 | 0,03 |
| 27.712 | Fannie Mae Pool | 5,00 % | 01.01.2044 | 28.138 | 0,03 |
| 8.172 | Fannie Mae Pool | 5,00 % | 01.03.2044 | 8.268 | 0,01 |
| 5.985 | Fannie Mae Pool | 5,00 % | 01.06.2048 | 6.013 | 0,01 |
| 40.491 | Fannie Mae Pool | 5,00 % | 01.09.2048 | 40.764 | 0,04 |
| 268.766 | Fannie Mae Pool | 5,00 % | 01.08.2052 | 266.346 | 0,24 |
| 67.891 | Fannie Mae Pool | 5,00 % | 01.09.2052 | 67.217 | 0,06 |
| 822.964 | Fannie Mae Pool | 5,00 % | 01.01.2053 | 815.449 | 0,75 |
| 368.816 | Fannie Mae Pool | 5,00 % | 01.02.2053 | 365.017 | 0,34 |
| 123.702 | Fannie Mae Pool | 5,00 % | 01.04.2053 | 122.428 | 0,11 |
| 441.694 | Fannie Mae Pool | 5,50 % | 01.12.2052 | 444.528 | 0,41 |
| 175.989 | Fannie Mae Pool | 5,50 % | 01.02.2053 | 176.829 | 0,16 |
| 37.427 | Fannie Mae Pool | 5,50 % | 01.05.2053 | 37.613 | 0,03 |
| 244.631 | Fannie Mae Pool | 5,50 % | 01.07.2053 | 245.765 | 0,23 |
| 77.899 | Fannie Mae Pool | 5,50 % | 01.09.2053 | 78.232 | 0,07 |
| 570.000 | Fannie Mae Pool | 5,50 % | 01.01.2054 | 572.494 | 0,53 |
| 98.189 | Fannie Mae Pool | 6,00 % | 01.06.2053 | 99.735 | 0,09 |

Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|--------------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Mortgage-Backed Securities 20,82 % (31. Dezember 2022: 14,14 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 379.907 | Fannie Mae Pool | 6,00 % | 01.10.2053 | 386.449 | 0,36 |
| 835.000 | Fannie Mae Pool | 6,00 % | 01.01.2054 | 847.916 | 0,78 |
| 266.167 | Fannie Mae Pool | 6,50 % | 01.10.2053 | 272.850 | 0,25 |
| 270.148 | Fannie Mae Pool | 6,50 % | 01.11.2053 | 276.931 | 0,25 |
| 272.907 | Fannie Mae Pool | 6,50 % | 01.12.2053 | 279.759 | 0,26 |
| 23.416 | Fannie Mae Pool (AJ7686) | 4,00 % | 01.12.2041 | 22.806 | 0,02 |
| 21.250 | Fannie Mae Pool (AL6432) | 4,00 % | 01.01.2045 | 20.495 | 0,02 |
| 16.109 | Fannie Mae Pool (AS7558) | 4,00 % | 01.07.2046 | 15.541 | 0,01 |
| 17.499 | Fannie Mae Pool (BH2877) | 4,00 % | 01.05.2047 | 16.877 | 0,02 |
| 244.531 | Fannie Mae Pool (BV7959) | 5,00 % | 01.08.2052 | 242.329 | 0,22 |
| 281.257 | Fannie Mae Pool (CB1552) | 2,50 % | 01.09.2051 | 239.396 | 0,22 |
| 281.956 | Fannie Mae Pool (CB4133) | 4,50 % | 01.07.2052 | 273.511 | 0,25 |
| 330.881 | Fannie Mae Pool (FS5235) | 5,50 % | 01.07.2053 | 332.409 | 0,31 |
| 411.693 | Fannie Mae Pool (MA4325) | 2,00 % | 01.05.2051 | 337.893 | 0,31 |
| 620.105 | Fannie Mae Pool (MA4701) | 4,50 % | 01.08.2052 | 601.532 | 0,55 |
| 22.908 | Freddie Mac Gold Pool | 3,50 % | 01.10.2042 | 21.654 | 0,02 |
| 24.741 | Freddie Mac Gold Pool | 3,50 % | 01.05.2043 | 23.306 | 0,02 |
| 15.388 | Freddie Mac Gold Pool | 3,50 % | 01.06.2043 | 14.488 | 0,01 |
| 11.961 | Freddie Mac Gold Pool | 3,50 % | 01.04.2045 | 11.183 | 0,01 |
| 55.351 | Freddie Mac Gold Pool | 3,50 % | 01.08.2045 | 51.750 | 0,05 |
| 12.059 | Freddie Mac Gold Pool | 3,50 % | 01.12.2045 | 11.274 | 0,01 |
| 11.987 | Freddie Mac Gold Pool | 3,50 % | 01.04.2046 | 11.207 | 0,01 |
| 114.693 | Freddie Mac Gold Pool | 3,50 % | 01.04.2047 | 107.229 | 0,10 |
| 48.293 | Freddie Mac Gold Pool | 3,50 % | 01.07.2047 | 45.311 | 0,04 |
| 16.514 | Freddie Mac Gold Pool | 3,50 % | 01.09.2047 | 15.408 | 0,01 |
| 23.106 | Freddie Mac Gold Pool | 3,50 % | 01.10.2047 | 21.602 | 0,02 |
| 125.896 | Freddie Mac Gold Pool | 3,50 % | 01.12.2047 | 117.702 | 0,11 |
| 38.903 | Freddie Mac Gold Pool | 4,00 % | 01.02.2041 | 37.998 | 0,03 |
| 27.764 | Freddie Mac Gold Pool | 4,00 % | 01.11.2041 | 27.055 | 0,02 |
| 15.258 | Freddie Mac Gold Pool | 4,00 % | 01.11.2044 | 14.741 | 0,01 |
| 11.861 | Freddie Mac Gold Pool | 4,00 % | 01.03.2046 | 11.455 | 0,01 |
| 86.671 | Freddie Mac Gold Pool | 4,00 % | 01.04.2046 | 83.707 | 0,08 |
| 14.289 | Freddie Mac Gold Pool | 4,00 % | 01.09.2046 | 13.800 | 0,01 |
| 169.555 | Freddie Mac Gold Pool | 4,00 % | 01.12.2046 | 163.772 | 0,15 |
| 71.269 | Freddie Mac Gold Pool | 4,00 % | 01.01.2047 | 68.831 | 0,06 |
| 87.802 | Freddie Mac Gold Pool | 4,00 % | 01.04.2047 | 84.753 | 0,08 |
| 13.924 | Freddie Mac Gold Pool | 4,00 % | 01.05.2047 | 13.448 | 0,01 |
| 36.902 | Freddie Mac Gold Pool | 4,50 % | 01.08.2039 | 36.922 | 0,03 |
| 11.487 | Freddie Mac Gold Pool | 4,50 % | 01.12.2039 | 11.493 | 0,01 |

Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--------------------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Mortgage-Backed Securities 20,82 % (31. Dezember 2022: 14,14 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 3.840 | Freddie Mac Gold Pool | 4,50 % | 01.03.2041 | 3.841 | 0,00 |
| 34.956 | Freddie Mac Gold Pool | 4,50 % | 01.11.2043 | 34.759 | 0,03 |
| 5.879 | Freddie Mac Gold Pool | 4,50 % | 01.10.2046 | 5.836 | 0,01 |
| 40.399 | Freddie Mac Gold Pool | 4,50 % | 01.09.2048 | 39.749 | 0,04 |
| 7.605 | Freddie Mac Gold Pool | 5,00 % | 01.10.2035 | 7.742 | 0,01 |
| 17.873 | Freddie Mac Gold Pool | 5,00 % | 01.09.2038 | 18.195 | 0,02 |
| 16.395 | Freddie Mac Gold Pool | 5,00 % | 01.03.2047 | 16.520 | 0,01 |
| 9.888 | Freddie Mac Gold Pool (Q18306) | 3,50 % | 01.05.2043 | 9.315 | 0,01 |
| 97.374 | Freddie Mac Pool | 2,00 % | 01.07.2051 | 79.837 | 0,07 |
| 487.429 | Freddie Mac Pool | 2,50 % | 01.12.2050 | 415.228 | 0,38 |
| 112.658 | Freddie Mac Pool | 2,50 % | 01.08.2051 | 96.055 | 0,09 |
| 415.864 | Freddie Mac Pool | 2,50 % | 01.01.2052 | 354.122 | 0,33 |
| 68.105 | Freddie Mac Pool | 3,00 % | 01.02.2050 | 61.039 | 0,06 |
| 41.075 | Freddie Mac Pool | 3,50 % | 01.03.2048 | 38.347 | 0,03 |
| 137.033 | Freddie Mac Pool | 4,50 % | 01.07.2052 | 132.929 | 0,12 |
| 340.847 | Freddie Mac Pool | 4,50 % | 01.08.2052 | 330.638 | 0,30 |
| 179.503 | Freddie Mac Pool | 5,00 % | 01.08.2052 | 177.886 | 0,16 |
| 316.439 | Freddie Mac Pool | 5,00 % | 01.10.2052 | 313.179 | 0,29 |
| 238.152 | Freddie Mac Pool | 5,50 % | 01.09.2052 | 239.914 | 0,22 |
| 236.991 | Freddie Mac Pool | 5,50 % | 01.11.2052 | 238.845 | 0,22 |
| 336.300 | Freddie Mac Pool | 5,50 % | 01.01.2053 | 338.014 | 0,31 |
| 186.994 | Freddie Mac Pool | 5,50 % | 01.03.2053 | 187.975 | 0,17 |
| 118.431 | Freddie Mac Pool | 5,50 % | 01.06.2053 | 118.956 | 0,11 |
| 54.060 | Freddie Mac Pool | 5,50 % | 01.07.2053 | 54.384 | 0,05 |
| 389.553 | Freddie Mac Pool | 6,00 % | 01.02.2053 | 395.973 | 0,36 |
| 358.311 | Freddie Mac Pool | 6,00 % | 01.03.2053 | 364.032 | 0,33 |
| 346.406 | Freddie Mac Pool | 6,00 % | 01.04.2053 | 351.864 | 0,32 |
| 639.635 | Freddie Mac Pool | 6,00 % | 01.05.2053 | 649.890 | 0,60 |
| 370.844 | Freddie Mac Pool | 6,00 % | 01.06.2053 | 376.686 | 0,35 |
| 82.001 | Freddie Mac Pool | 6,00 % | 01.09.2053 | 83.280 | 0,08 |
| 272.883 | Freddie Mac Pool | 6,50 % | 01.09.2053 | 280.584 | 0,26 |
| 453.136 | Freddie Mac Pool (SD3010) | 5,50 % | 01.06.2053 | 456.348 | 0,42 |
| 380.135 | Freddie Mac Pool (SD3908) | 6,00 % | 01.09.2053 | 387.179 | 0,36 |
| 128.566 | Freddie Mac Pool (SD8221) | 3,50 % | 01.06.2052 | 117.972 | 0,11 |
| 109.352 | Ginnie Mae II Pool | 2,50 % | 20.03.2051 | 95.681 | 0,09 |
| 359.282 | Ginnie Mae II Pool | 2,50 % | 20.04.2051 | 314.663 | 0,29 |
| 187.808 | Ginnie Mae II Pool | 4,50 % | 20.09.2052 | 183.397 | 0,17 |
| 135.689 | Ginnie Mae II Pool | 5,00 % | 20.03.2053 | 134.850 | 0,12 |
| 103.882 | Ginnie Mae II Pool | 5,00 % | 20.07.2053 | 103.143 | 0,09 |

Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| Mortgage-Backed Securities 20,82 % (31. Dezember 2022: 14,14 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 168.582 | Ginnie Mae II Pool | 5,50 % | 20.03.2053 | 169.888 | 0,16 |
| 237.743 | Ginnie Mae II Pool | 6,00 % | 20.08.2053 | 241.849 | 0,22 |
| Mortgage-Backed Securities insgesamt ** | | | | 22.645.649 | 20,82 |
| Kommunalanleihen 1,18 % (31. Dezember 2022: 1,27 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 520.000 | New York City Municipal Water Finance Authority | 6,01 % | 15.06.2042 | 586.632 | 0,54 |
| 325.000 | State of California | 4,60 % | 01.04.2038 | 313.926 | 0,29 |
| 500.000 | State of Hawaii | 2,85 % | 01.10.2040 | 378.218 | 0,35 |
| Kommunalanleihen insgesamt † | | | | 1.278.776 | 1,18 |
| Anlagen insgesamt | | | | 107.272.645 | 98,65 |

Devisenterminkontrakte 3,07 % (31. Dezember 2022: 1,96 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeits- datum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettöver- mögens |
|-----------------------|------------------------|-----------------------|--------------------------------|-----------|-----------------------------------|------------------------------|
| 1.164.861 AUD | 744.219 US\$ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 1 | 51.037 | 0,05 |
| 3.544.085 AUD | 2.254.524 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 5 | 165.042 | 0,15 |
| 1.136.822 AUD | 740.528 US\$ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 3 | 35.586 | 0,03 |
| 3.244.635 AUD | 2.089.524 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 5 | 125.605 | 0,12 |
| 268.472 AUD | 174.587 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | 8.700 | 0,01 |
| 2.967.931 AUD | 1.888.455 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | 137.767 | 0,13 |
| 2.660.392 BRL | 520.817 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | 26.264 | 0,02 |
| 1.119.811 CAD | 812.601 US\$ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 3 | 36.834 | 0,03 |
| 2.399.644 CAD | 1.750.297 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | 69.960 | 0,07 |
| 242.887 CAD | 177.382 US\$ | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 1 | 6.861 | 0,01 |
| 271.034 CAD | 201.796 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 3.798 | 0,00 |
| 944.652 CAD | 685.558 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 3 | 31.010 | 0,03 |
| 233.282 CAD | 172.082 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 4.875 | 0,01 |
| 774.916 CHF | 867.115 US\$ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 2 | 55.098 | 0,05 |
| 454.526 CHF | 506.758 US\$ | 18.01.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | 34.165 | 0,03 |
| 1.094.115 CHF | 1.230.021 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | 72.064 | 0,07 |
| 318.657 CHF | 358.606 US\$ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 20.622 | 0,02 |
| 792.057 CHF | 885.348 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 2 | 57.264 | 0,05 |
| 944.534 CHF | 1.081.029 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | 43.043 | 0,04 |
| 74.993 CHF | 84.146 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 5.101 | 0,01 |
| 160.433.264 CLP | 172.853 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 10.718 | 0,01 |
| 70.844.418 CLP | 76.085 US\$ | 18.01.2024 | Société Générale | 1 | 4.976 | 0,01 |
| 345.634.694 CLP | 370.059 US\$ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 25.424 | 0,02 |
| 4.075.031 CNY | 560.250 US\$ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 12.661 | 0,01 |
| 920.927 CNY | 127.505 US\$ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 2 | 2.589 | 0,00 |

Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 3,07 % (31. Dezember 2022: 1,96 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|------------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 503.379 CNY | 70.837 US\$ | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 1 | 273 | 0,00 |
| 76.514.161 CNY | 10.604.979 US\$ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 3 | 203.698 | 0,19 |
| 562.437.353 COP | 129.742 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 14.974 | 0,01 |
| 8.733.188 CZK | 375.858 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | 14.698 | 0,01 |
| 8.244.034 CZK | 359.466 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | 9.214 | 0,01 |
| 110.000 DKK | 15.588 US\$ | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 1 | 726 | 0,00 |
| 2.926.898 € | 3.122.208 US\$ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 7 | 113.002 | 0,10 |
| 900.000 € | 970.893 US\$ | 18.01.2024 | Canadian Imperial Bank of Commerce | 1 | 23.911 | 0,02 |
| 2.168.533 € | 2.330.957 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 4 | 66.004 | 0,06 |
| 1.774.558 € | 1.888.129 US\$ | 18.01.2024 | Société Générale | 3 | 73.356 | 0,07 |
| 1.022.980 € | 1.092.816 US\$ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 4 | 37.922 | 0,04 |
| 735.457 € | 793.518 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 3 | 19.410 | 0,02 |
| 1.237.017 € | 1.341.893 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 4 | 25.428 | 0,02 |
| 1.264.778 € | 1.384.817 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | 13.190 | 0,01 |
| 849.442 £ | 1.039.214 US\$ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 3 | 43.749 | 0,04 |
| 280.616 £ | 352.342 US\$ | 18.01.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | 5.418 | 0,01 |
| 721.046 £ | 875.020 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | 44.251 | 0,04 |
| 284.949 £ | 350.000 US\$ | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 1 | 13.285 | 0,01 |
| 300.000 £ | 366.501 US\$ | 18.01.2024 | Société Générale | 1 | 15.973 | 0,02 |
| 875.934 £ | 1.092.110 US\$ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 5 | 24.628 | 0,02 |
| 687.200 £ | 853.414 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 4 | 22.706 | 0,02 |
| 432.184 £ | 537.004 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | 13.993 | 0,01 |
| 110.000 £ | 139.216 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 1.024 | 0,00 |
| 223.568 HKD | 28.631 US\$ | 18.01.2024 | Société Générale | 1 | 10 | 0,00 |
| 95.440.648 HUF | 264.059 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | 11.162 | 0,01 |
| 73.482.032 HUF | 197.861 US\$ | 18.01.2024 | Société Générale | 2 | 14.038 | 0,01 |
| 64.151.109 HUF | 181.926 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | 3.066 | 0,00 |
| 2.585.137.634 IDR | 165.767 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 1.918 | 0,00 |
| 2.004.836.042 IDR | 126.701 US\$ | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 2 | 3.343 | 0,00 |
| 937.662.828 IDR | 60.710 US\$ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 111 | 0,00 |
| 3.133.715 IDR | 199 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | 4 | 0,00 |
| 568.748 ILS | 144.681 US\$ | 18.01.2024 | Société Générale | 1 | 13.307 | 0,01 |
| 79.532.567 ¥ | 542.554 US\$ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 2 | 22.948 | 0,02 |
| 27.000.000 ¥ | 188.257 US\$ | 18.01.2024 | Canadian Imperial Bank of Commerce | 1 | 3.721 | 0,00 |
| 229.816.701 ¥ | 1.548.213 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 85.856 | 0,08 |
| 1.005.159.939 ¥ | 6.852.851 US\$ | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 2 | 294.149 | 0,27 |
| 21.795.910 ¥ | 147.900 US\$ | 18.01.2024 | Société Générale | 1 | 7.075 | 0,01 |
| 115.121.993 ¥ | 785.103 US\$ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 33.450 | 0,03 |
| 89.397.501 ¥ | 621.589 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 4 | 14.055 | 0,01 |
| 179.603.849 ¥ | 1.208.481 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | 68.558 | 0,06 |
| 439.000.000 KRW | 338.353 US\$ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 1 | 396 | 0,00 |

Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 3,07 % (31. Dezember 2022: 1,96 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|------------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 79.490 KRW | 60 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 2 | 0,00 |
| 3.123.700.000 KRW | 2.398.437 US\$ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 11.932 | 0,01 |
| 226.000.000 KRW | 168.381 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | 6.009 | 0,01 |
| 700.000 MXN | 39.892 US\$ | 18.01.2024 | Canadian Imperial Bank of Commerce | 1 | 1.337 | 0,00 |
| 18.067.615 MXN | 974.181 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | 89.958 | 0,08 |
| 6.183.447 MXN | 349.249 US\$ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 14.941 | 0,01 |
| 3.122.924 MXN | 177.644 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 6.288 | 0,01 |
| 2.000.630 MYR | 426.283 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 10.350 | 0,01 |
| 6.639.894 NOK | 613.498 US\$ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 4 | 40.576 | 0,04 |
| 1.927.265 NOK | 178.721 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 11.127 | 0,01 |
| 2.930.156 NOK | 265.489 US\$ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 23.151 | 0,02 |
| 1.955.008 NOK | 174.589 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 17.993 | 0,02 |
| 17.021.100 NOK | 1.557.335 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 4 | 119.356 | 0,11 |
| 292.014 NZD | 175.877 US\$ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 1 | 9.023 | 0,01 |
| 1.478.707 NZD | 861.863 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | 74.437 | 0,07 |
| 57.000 NZD | 27.432 £ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 1.118 | 0,00 |
| 3.151.225 NZD | 1.849.350 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 6 | 145.971 | 0,13 |
| 1.027.717 NZD | 618.179 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 4 | 32.561 | 0,03 |
| 27.000 NZD | 14.986 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 531 | 0,00 |
| 250.572 PEN | 65.030 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 2.612 | 0,00 |
| 1.468.541 PLN | 356.931 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | 16.453 | 0,02 |
| 175.000 PLN | 33.850 £ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 1.338 | 0,00 |
| 730.345 PLN | 175.567 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 10.127 | 0,01 |
| 2.182.938 PLN | 523.293 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 3 | 31.730 | 0,03 |
| 540.000 PLN | 136.824 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 473 | 0,00 |
| 439.804 RON | 95.430 US\$ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 1 | 2.209 | 0,00 |
| 10.394.837 SEK | 949.816 US\$ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 4 | 82.296 | 0,08 |
| 5.702.995 SEK | 515.420 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | 50.835 | 0,05 |
| 7.579.308 SEK | 698.940 US\$ | 18.01.2024 | Société Générale | 2 | 53.616 | 0,05 |
| 120.000 SEK | 8.921 £ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 541 | 0,00 |
| 4.654.420 SEK | 455.043 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 7.098 | 0,01 |
| 351.517 SGD | 258.600 US\$ | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 1 | 8.077 | 0,01 |
| 13.530.200 THB | 371.763 US\$ | 18.01.2024 | Société Générale | 1 | 25.183 | 0,02 |
| 57.765 US\$ | 74.810.335 KRW | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 38 | 0,00 |
| 32.905 ZAR | 1.705 US\$ | 18.01.2024 | Société Générale | 1 | 92 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> | | | | | | |
| 1.461 AUD | 957 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 5 | 41 | 0,00 |
| 28.805 AUD | 18.586 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 8 | 1.080 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 6.343 € | 6.759 US\$ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 1 | 252 | 0,00 |
| 83 € | 636 CNY | 18.01.2024 | BNP Paribas | 1 | 2 | 0,00 |

Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 3,07 % (31. Dezember 2022: 1,96 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR (Fortsetzung)</i> | | | | | | |
| 2.539 € | 19.487 CNY | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 54 | 0,00 |
| 58 € | 83 SGD | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 1 | 0,00 |
| 325 € | 462.536 KRW | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 1 | 2 | 0,00 |
| 6.348 € | 6.759 US\$ | 18.01.2024 | Société Générale | 1 | 258 | 0,00 |
| 125 € | 2.088.240 IDR | 18.01.2024 | Société Générale | 1 | 2 | 0,00 |
| 748 € | 1.079 CAD | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 9 | 0,00 |
| 5.621 ¥ | 36 € | 18.01.2024 | BNP Paribas | 1 | 0 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen USD</i> | | | | | | |
| 87 € | 93 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | 3 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i> | | | | | | |
| 316.445 ZAR | 16.351 US\$ | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 2 | 930 | 0,00 |
| 20.010 ZAR | 1.053 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 5 | 39 | 0,00 |
| 12.667 ZAR | 687 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 4 | 4 | 0,00 |
| 7.336 ZAR | 392 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 4 | 9 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | 3.337.129 | 3,07 |

Futures-Kontrakte 0,41 % (31. Dezember 2022: 0,20 %)

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---|--------------------------------|----------------------|
| 3 | 10-Year Mini Japanese Government Bond Future March 2024 | 2.674 | 0,00 |
| 2 | Australian Government Bond 10-Year Future March 2024 | 5.067 | 0,00 |
| 2 | Canadian 10-Year Bond Future March 2024 | 9.100 | 0,01 |
| 14 | Canadian 5-Year Bond Future March 2024 | 32.170 | 0,03 |
| 28 | Euro-BOBL Future March 2024 | 63.098 | 0,06 |
| 3 | Euro-BTP Future March 2024 | 14.051 | 0,01 |
| 5 | Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2024 | 59.872 | 0,06 |
| 5 | Euro-OAT Future March 2024 | 25.186 | 0,02 |
| 45 | Euro-Schatz Future March 2024 | 32.311 | 0,03 |
| 6 | United Kingdom Long Gilt Future March 2024 | 37.760 | 0,04 |
| 6 | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2024 | 22.279 | 0,02 |
| 18 | US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2024 | 32.849 | 0,03 |
| 24 | US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2024 | 39.703 | 0,04 |
| 5 | US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2024 | 64.570 | 0,06 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten [*] | | 440.690 | 0,41 |

Zinsswap-Kontrakte 0,11 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)

| Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei | Erhalt/(Zahlung) [#] | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|----------------|------------|-------------------------------|-------------------------------|-----------------|--------------------|--------------------------------|----------------------|
| CNY 31.096.000 | 28.11.2025 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 2,60 % | 7D CNRR | 49.787 | 0,05 |
| CNY 9.273.000 | 30.11.2027 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 2,82 % | 7D CNRR | 31.192 | 0,03 |

Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Zinsswap-Kontrakte 0,11 % (31. Dezember 2022: 0,00 %) (Fortsetzung)

| | Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei | Erhalt/(Zahlung) [#] | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|-------------|------------|-------------------------------|-------------------------------|-----------------|--------------------|--------------------------------|----------------------|
| EUR | 1.780.000 | 02.11.2035 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 3,63 % | 1D €STR | 27.654 | 0,02 |
| CNY | 9.773.000 | 31.05.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 2,50 % | 7D CNRR | 16.075 | 0,01 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten [™] | | | | | | | 124.708 | 0,11 |

[#]Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

¹Zentral abgewickelter Swap.

| | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|--------------------|----------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 111.175.172 | 102,24 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (2,94 %) (31. Dezember 2022: (1,42 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 48.216 € | 42.000 £ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | (252) | (0,00) |
| 300.000 € | 288.440 CHF | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | (11.666) | (0,01) |
| 3.000 £ | 3.464 € | 18.01.2024 | Société Générale | 1 | (4) | (0,00) |
| 856.832 US\$ | 6.128.433 CNY | 18.01.2024 | BNP Paribas | 3 | (8.893) | (0,01) |
| 1.064.209 US\$ | 11.733.648 NOK | 18.01.2024 | BNP Paribas | 4 | (91.633) | (0,08) |
| 880.773 US\$ | 1.482.688 NZD | 18.01.2024 | BNP Paribas | 3 | (58.048) | (0,05) |
| 522.355 US\$ | 2.200.583 PLN | 18.01.2024 | BNP Paribas | 2 | (37.153) | (0,03) |
| 1.742.638 US\$ | 2.708.815 AUD | 18.01.2024 | BNP Paribas | 5 | (106.684) | (0,10) |
| 92.759 US\$ | 34.017.402 HUF | 18.01.2024 | BNP Paribas | 1 | (5.337) | (0,01) |
| 1.358.233 US\$ | 198.572.552 ¥ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 3 | (53.679) | (0,05) |
| 484.745 US\$ | 5.250.684 SEK | 18.01.2024 | BNP Paribas | 3 | (36.599) | (0,03) |
| 1.644.192 US\$ | 1.463.231 CHF | 18.01.2024 | BNP Paribas | 5 | (97.170) | (0,09) |
| 181.344 US\$ | 169.258.971 CLP | 18.01.2024 | BNP Paribas | 1 | (12.326) | (0,01) |
| 2.446.367 US\$ | 3.340.443 CAD | 18.01.2024 | BNP Paribas | 7 | (87.535) | (0,08) |
| 512.298 US\$ | 9.275.943 MXN | 18.01.2024 | BNP Paribas | 2 | (34.031) | (0,03) |
| 502.094 US\$ | 408.265 £ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 2 | (18.408) | (0,02) |
| 1.227.217 US\$ | 1.146.890 € | 18.01.2024 | BNP Paribas | 3 | (40.483) | (0,04) |
| 172.964 US\$ | 136.058 £ | 18.01.2024 | Citibank NA | 1 | (498) | (0,00) |
| 513.454 US\$ | 481.525 € | 18.01.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | (18.794) | (0,02) |
| 359.304 US\$ | 6.570.551 MXN | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (27.686) | (0,03) |
| 519.553 US\$ | 2.181.227 PLN | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (35.033) | (0,03) |
| 3.731.074 US\$ | 4.978.521.917 KRW | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (110.546) | (0,10) |
| 347.061 US\$ | 1.728.547 BRL | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (8.395) | (0,01) |
| 2.155.459 US\$ | 23.373.727 SEK | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 7 | (165.336) | (0,15) |

Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (2,94 %) (31. Dezember 2022: (1,42 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 1.612.799 US\$ | 2.504.416 AUD | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 6 | (96.979) | (0,09) |
| 1.097.875 US\$ | 891.752 £ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | (39.031) | (0,04) |
| 55.768 US\$ | 1.956.580 THB | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (1.633) | (0,00) |
| 1.052.318 US\$ | 1.445.601 CAD | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 4 | (44.247) | (0,04) |
| 2.127.439 US\$ | 3.549.205 NZD | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 5 | (119.877) | (0,11) |
| 715.416 US\$ | 105.538.674 ¥ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (34.996) | (0,03) |
| 585.147 US\$ | 527.024 CHF | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (42.054) | (0,04) |
| 3.076.425 US\$ | 2.851.105 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 6 | (75.009) | (0,07) |
| 36.479 US\$ | 32.000 CHF | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 1 | (1.604) | (0,00) |
| 58.753 US\$ | 93.667 NZD | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 1 | (555) | (0,00) |
| 440.341 US\$ | 63.761.214 ¥ | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 2 | (13.021) | (0,01) |
| 122.483 US\$ | 1.908.512.687 IDR | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 2 | (1.313) | (0,00) |
| 94.616 US\$ | 86.702 € | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 1 | (1.219) | (0,00) |
| 132.591 US\$ | 175.992.362 KRW | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 2 | (3.212) | (0,00) |
| 1.893.369 US\$ | 1.781.092 € | 18.01.2024 | Société Générale | 1 | (75.339) | (0,07) |
| 4.094.628 US\$ | 3.340.866 £ | 18.01.2024 | Société Générale | 2 | (164.682) | (0,15) |
| 719.926 US\$ | 5.068.130 DKK | 18.01.2024 | Société Générale | 1 | (31.693) | (0,03) |
| 971.686 US\$ | 10.307.569 SEK | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 2 | (51.760) | (0,05) |
| 560.911 US\$ | 4.075.949 CNY | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | (12.129) | (0,01) |
| 347.514 US\$ | 323.187.749 CLP | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | (22.284) | (0,02) |
| 881.788 US\$ | 1.210.667 CAD | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 2 | (36.567) | (0,03) |
| 881.953 US\$ | 723.365 £ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | (40.274) | (0,04) |
| 611.959 US\$ | 87.651.249 ¥ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | (11.269) | (0,01) |
| 338.083 US\$ | 6.251.659 MXN | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | (30.124) | (0,03) |
| 411.187 US\$ | 2.940.159 CNY | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 4 | (4.150) | (0,00) |
| 2.436.450 US\$ | 2.296.258 € | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 5 | (101.689) | (0,09) |
| 69.107 US\$ | 472.793 DKK | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | (1.009) | (0,00) |
| 1.113.162 US\$ | 12.308.620 SEK | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 4 | (108.971) | (0,10) |
| 539.744 US\$ | 5.899.053 NOK | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 2 | (41.351) | (0,04) |
| 952.011 US\$ | 1.454.561 AUD | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 3 | (41.026) | (0,04) |
| 627.439 US\$ | 857.807 CAD | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 2 | (23.252) | (0,02) |
| 814.313 US\$ | 117.171.615 ¥ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 2 | (18.813) | (0,02) |
| 376.922 US\$ | 303.851 £ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 2 | (10.461) | (0,01) |
| 89.604 US\$ | 31.973.212 HUF | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | (2.597) | (0,00) |
| 244.969 US\$ | 4.376.701 MXN | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 2 | (12.807) | (0,01) |
| 168.043 US\$ | 271.025 NZD | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | (3.567) | (0,00) |
| 2.657.887 US\$ | 2.479.194 € | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 7 | (82.460) | (0,08) |
| 1.072.404 US\$ | 960.858 CHF | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 2 | (71.095) | (0,07) |
| 173.859 US\$ | 63.430.886 HUF | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (9.056) | (0,01) |
| 362.008 US\$ | 599.376 NZD | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (17.511) | (0,02) |
| 692.462 US\$ | 101.898.884 ¥ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (32.071) | (0,03) |

Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (2,94 %) (31. Dezember 2022: (1,42 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 1.879.421 US\$ | 1.757.809 € | 18.01.2024 | UBS AG | 4 | (63.551) | (0,06) |
| 150.953 US\$ | 119.098 £ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (887) | (0,00) |
| 362.048 US\$ | 8.412.570 CZK | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | (14.169) | (0,01) |
| 212.970 US\$ | 928.698 PLN | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (23.155) | (0,02) |
| 3.287.793 US\$ | 2.902.957 CHF | 18.01.2024 | UBS AG | 4 | (166.961) | (0,15) |
| 2.150.805 US\$ | 33.842.792.935 IDR | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (44.413) | (0,04) |
| 974.241 US\$ | 10.672.857 NOK | 18.01.2024 | UBS AG | 3 | (77.105) | (0,07) |
| 175.194 US\$ | 1.835.584 SEK | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (7.062) | (0,01) |
| 1.589.227 US\$ | 2.483.050 AUD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | (105.964) | (0,10) |
| 901.472 US\$ | 835.327 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | (21.846) | (0,02) |
| 418.792 US\$ | 343.060 £ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | (18.579) | (0,02) |
| 881.592 US\$ | 1.474.210 NZD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (51.861) | (0,05) |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> | | | | | | |
| 309 AUD | 212 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | (1) | (0,00) |
| 165 US\$ | 260 AUD | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | (12) | (0,00) |
| 309 US\$ | 475 AUD | 18.01.2024 | UBS AG | 3 | (15) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 385 € | 638 AUD | 18.01.2024 | BNP Paribas | 1 | (10) | (0,00) |
| 52 € | 602 SEK | 18.01.2024 | BNP Paribas | 1 | (2) | (0,00) |
| 16 € | 14 £ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 1 | (0) | (0,00) |
| 42 € | 76 NZD | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (1) | (0,00) |
| 1.084 € | 940 £ | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 1 | (0) | (0,00) |
| 89 € | 1.713 MXN | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 1 | (3) | (0,00) |
| 150 € | 143 CHF | 18.01.2024 | Société Générale | 1 | (4) | (0,00) |
| 3.076 € | 480.086 ¥ | 18.01.2024 | Société Générale | 2 | (13) | (0,00) |
| 52 € | 602 SEK | 18.01.2024 | Société Générale | 1 | (2) | (0,00) |
| 157 US\$ | 147 € | 18.01.2024 | BNP Paribas | 1 | (5) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen USD</i> | | | | | | |
| 86 US\$ | 623 CNY | 18.01.2024 | BNP Paribas | 1 | (2) | (0,00) |
| 136 US\$ | 128 € | 18.01.2024 | BNP Paribas | 1 | (6) | (0,00) |
| 65 US\$ | 88 SGD | 18.01.2024 | BNP Paribas | 1 | (2) | (0,00) |
| 29 US\$ | 24 £ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 1 | (1) | (0,00) |
| 40 US\$ | 5.847 ¥ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 1 | (2) | (0,00) |
| 6.473 US\$ | 6.116 € | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 1 | (287) | (0,00) |
| 3.273 US\$ | 477.879 ¥ | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 1 | (125) | (0,00) |
| 1.154 US\$ | 948 £ | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 1 | (54) | (0,00) |
| 97 US\$ | 1.800 MXN | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 1 | (9) | (0,00) |
| 107 US\$ | 1.169 SEK | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 1 | (9) | (0,00) |
| 158 US\$ | 143 CHF | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 1 | (12) | (0,00) |
| 47 US\$ | 79 NZD | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 1 | (3) | (0,00) |
| 63 US\$ | 442 DKK | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 1 | (3) | (0,00) |

Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (2,94 %) (31. Dezember 2022: (1,42 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen USD (Fortsetzung)</i> | | | | | | |
| 793 US\$ | 1.087 CAD | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (32) | (0,00) |
| 406 US\$ | 637 AUD | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (29) | (0,00) |
| 135 US\$ | 2.125.094 IDR | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (3) | (0,00) |
| 2.766 US\$ | 19.893 CNY | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (44) | (0,00) |
| 349 US\$ | 464.591 KRW | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (10) | (0,00) |
| 89 US\$ | 3.262 THB | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | (7) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i> | | | | | | |
| 380 US\$ | 7.158 ZAR | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 3 | (11) | (0,00) |
| 311 US\$ | 5.884 ZAR | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | (10) | (0,00) |
| 4.698 ZAR | 257 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | (0) | (0,00) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ^{oo} | | | | | (3.195.228) | (2,94) |

Futures-Kontrakte (0,57 %) (31. Dezember 2022: (0,14 %))

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|--|---------------------------------|----------------------|
| (33) | Euro-Bund Future March 2024 | (111.757) | (0,10) |
| (19) | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2024 | (70.858) | (0,06) |
| (68) | US Treasury 10-Year Ultra Future March 2024 | (390.469) | (0,36) |
| (8) | US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2024 | (19.724) | (0,02) |
| (3) | US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2024 | (30.164) | (0,03) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten [*] | | (622.972) | (0,57) |

Credit-Default-Swap-Kontrakte (0,07 %) (31. Dezember 2022: (0,01 %))

| Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei | Referenzverbindlichkeit | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|---|------------|-----------------------------|--|-----------------|----------------------|
| USD 3.720.000 | 20.12.2028 | ICE Clear U.S. ¹ | Buying default protection on CDX.NA.JG.41.V1 | (72.291) | (0,07) |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt [*] | | | | (72.291) | (0,07) |

¹Zentral abgewickelter Swap.

| | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|---|--------------------|----------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (3.890.491) | (3,58) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | 107.284.681 | 98,66 |
| Sonstiges Nettovermögen | 1.458.119 | 1,34 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | 108.742.800 | 100,00 |

Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

| Portfolioanalyse | US\$ Gesamtvermögens | % des |
|---|----------------------|--------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 59.984.843 | 52,53 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 45.448.259 | 39,80 |
| † Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente | 1.839.543 | 1,61 |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | (182.282) | (0,16) |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap | 194.318 | 0,17 |
| Anlagen insgesamt | 107.284.681 | 93,95 |

Global Diversified Income FMP - 2024 - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Schatzwechsel 12,01 % (31. Dezember 2022: 0,00 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 18.810.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 18.01.2024 | 18.765.889 | 12,01 |
| Schatzwechsel insgesamt ** | | | | 18.765.889 | 12,01 |
| Unternehmensanleihen 79,04 % (31. Dezember 2022: 93,73 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 400.000 | ABJA Investment Co Pte Ltd** | 5,95 % | 31.07.2024 | 399.120 | 0,26 |
| 249.000 | Adani Ports & Special Economic Zone Ltd** | 3,38 % | 24.07.2024 | 244.198 | 0,16 |
| 2.944.000 | Africa Finance Corp* | 3,88 % | 13.04.2024 | 2.923.813 | 1,87 |
| 1.444.000 | African Export-Import Bank* | 4,13 % | 20.06.2024 | 1.431.423 | 0,92 |
| 3.000.000 | Air Lease Corp* | 0,70 % | 15.02.2024 | 2.981.605 | 1,91 |
| 1.000.000 | Air Lease Corp* | 4,25 % | 01.02.2024 | 998.460 | 0,64 |
| 1.100.000 | Anglo American Capital Plc* | 3,63 % | 11.09.2024 | 1.082.747 | 0,69 |
| 1.500.000 | Ares Capital Corp** | 4,20 % | 10.06.2024 | 1.485.981 | 0,95 |
| 4.100.000 | Athene Global Funding** | 2,75 % | 25.06.2024 | 4.034.439 | 2,58 |
| 3.120.000 | Avolon Holdings Funding Ltd** | 5,25 % | 15.05.2024 | 3.103.756 | 1,99 |
| 3.389.000 | Bank Mandiri Persero Tbk PT* | 3,75 % | 11.04.2024 | 3.369.128 | 2,16 |
| 3.250.000 | Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT** | 3,95 % | 28.03.2024 | 3.238.616 | 2,07 |
| 4.000.000 | Barclays Plc* | 4,38 % | 11.09.2024 | 3.952.105 | 2,53 |
| 435.000 | Bharti Airtel International Netherlands BV* | 5,35 % | 20.05.2024 | 434.695 | 0,28 |
| 2.500.000 | Black Sea Trade & Development Bank* | 3,50 % | 25.06.2024 | 2.423.608 | 1,55 |
| 3.000.000 | BOC Aviation Ltd** | 4,00 % | 25.01.2024 | 2.996.820 | 1,92 |
| 3.005.000 | Buckeye Partners LP** | 4,35 % | 15.10.2024 | 2.947.792 | 1,89 |
| 750.000 | CSC Holdings LLC** | 5,25 % | 01.06.2024 | 734.731 | 0,47 |
| 1.333.000 | Eastern & Southern African Trade & Development Bank* | 4,88 % | 23.05.2024 | 1.318.964 | 0,84 |
| 2.200.000 | Energy Transfer LP* | 3,90 % | 15.05.2024 | 2.183.875 | 1,40 |
| 3.685.000 | EQM Midstream Partners LP* | 4,00 % | 01.08.2024 | 3.652.543 | 2,34 |
| 1.040.000 | Ford Motor Credit Co LLC* | 3,81 % | 09.01.2024 | 1.039.541 | 0,67 |
| 3.385.000 | Ford Motor Credit Co LLC* | 5,58 % | 18.03.2024 | 3.380.855 | 2,16 |
| 4.550.000 | General Motors Financial Co Inc* | 3,95 % | 13.04.2024 | 4.523.747 | 2,90 |
| 944.000 | Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd* | 5,13 % | 15.05.2024 | 938.827 | 0,60 |
| 4.750.000 | HSBC Holdings Plc* | 4,25 % | 14.03.2024 | 4.732.594 | 3,03 |
| 1.600.000 | Huarong Finance 2019 Co Ltd* | 3,25 % | 13.11.2024 | 1.552.000 | 0,99 |
| 1.100.000 | Huarong Finance 2019 Co Ltd* | 3,75 % | 29.05.2024 | 1.085.161 | 0,69 |
| 2.500.000 | Hyundai Capital America** | 3,40 % | 20.06.2024 | 2.470.678 | 1,58 |
| 1.930.000 | Live Nation Entertainment Inc** | 4,88 % | 01.11.2024 | 1.914.309 | 1,23 |
| 1.500.000 | Marriott International Inc** | 3,60 % | 15.04.2024 | 1.492.714 | 0,96 |
| 3.800.000 | Mashreqbank PSC* | 4,25 % | 26.02.2024 | 3.796.846 | 2,43 |
| 1.450.000 | MGM China Holdings Ltd** | 5,38 % | 15.05.2024 | 1.447.963 | 0,93 |
| 889.000 | Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd* | 3,38 % | 29.12.2049 | 874.554 | 0,56 |
| 3.000.000 | Nationwide Building Society* | 0,55 % | 22.01.2024 | 2.992.276 | 1,92 |

Global Diversified Income FMP - 2024 - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 79,04 % (31. Dezember 2022: 93,73 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 4.600.000 | NatWest Group Plc* | 5,13 % | 28.05.2024 | 4.578.556 | 2,93 |
| 1.803.000 | NOVA Chemicals Corp** | 4,88 % | 01.06.2024 | 1.788.955 | 1,14 |
| 4.000.000 | NRG Energy Inc** | 3,75 % | 15.06.2024 | 3.954.818 | 2,53 |
| 518.000 | Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc** | 5,25 % | 15.04.2024 | 515.115 | 0,33 |
| 1.500.000 | QIB Sukuk Ltd* | 3,98 % | 26.03.2024 | 1.492.387 | 0,96 |
| 1.000.000 | QIIB Senior Sukuk Ltd* | 4,26 % | 05.03.2024 | 996.786 | 0,64 |
| 2.500.000 | Rakfunding Cayman Ltd* | 4,13 % | 09.04.2024 | 2.487.397 | 1,59 |
| 1.250.000 | REC Ltd* | 3,38 % | 25.07.2024 | 1.234.915 | 0,79 |
| 450.000 | REC Ltd* | 3,50 % | 12.12.2024 | 441.526 | 0,28 |
| 1.889.000 | Saudi Electricity Global Sukuk Co 4* | 4,22 % | 27.01.2024 | 1.888.437 | 1,21 |
| 1.500.000 | Shriram Finance Ltd* | 4,40 % | 13.03.2024 | 1.490.880 | 0,95 |
| 2.500.000 | SNB Funding Ltd* | 2,75 % | 02.10.2024 | 2.442.095 | 1,56 |
| 2.600.000 | Societe Generale SA** | 2,63 % | 16.10.2024 | 2.539.787 | 1,63 |
| 4.015.000 | Sprint LLC** | 7,13 % | 15.06.2024 | 4.035.123 | 2,58 |
| 3.850.000 | Synchrony Financial* | 4,25 % | 15.08.2024 | 3.809.341 | 2,44 |
| 3.180.000 | TRI Pointe Group Inc/TRI Pointe Homes Inc* | 5,88 % | 15.06.2024 | 3.183.641 | 2,04 |
| 2.600.000 | Ventas Realty LP* | 3,50 % | 15.04.2024 | 2.580.629 | 1,65 |
| 4.000.000 | Warnermedia Holdings Inc† | 3,53 % | 15.03.2024 | 3.955.359 | 2,53 |
| 1.000.000 | Weibo Corp* | 3,50 % | 05.07.2024 | 989.385 | 0,63 |
| 889.000 | Wynn Macau Ltd* | 4,88 % | 01.10.2024 | 878.369 | 0,56 |
| Unternehmensanleihen insgesamt | | | | 123.463.985 | 79,04 |
| Staatsanleihen 1,11 % (31. Dezember 2022: 2,45 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 1.300.000 | Egypt Government International Bond | 6,20 % | 01.03.2024 | 1.284.084 | 0,82 |
| 444.000 | Republic of South Africa Government International Bond | 4,67 % | 17.01.2024 | 443.909 | 0,29 |
| Staatsanleihen insgesamt * | | | | 1.727.993 | 1,11 |
| Anlagen insgesamt | | | | 143.957.867 | 92,16 |

Devisenterminkontrakte 0,18 % (31. Dezember 2022: 0,33 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeits- datum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettöver- mögens |
|---------------------------------|------------------------|-----------------------|----------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 2.321.841 € | 2.473.592 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 3 | 92.826 | 0,06 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 1.879.639 £ | 2.307.839 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | 88.534 | 0,06 |
| 23.430 £ | 28.540 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 1.331 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen HKD</i> | | | | | | |
| 6.868.511 HKD | 879.585 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 3 | 333 | 0,00 |

Global Diversified Income FMP - 2024 - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 0,18 % (31. Dezember 2022: 0,33 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|----------------------|-----------|--------------------------------|----------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i> | | | | | | |
| 4.396.662 SGD | 3.236.808 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | 98.708 | 0,06 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | 281.732 | 0,18 |
| | | | | | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | | | | | 144.239.599 | 92,34 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | | | | | 144.239.599 | 92,34 |
| Sonstiges Nettovermögen | | | | | 11.960.054 | 7,66 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | | | | | 156.199.653 | 100,00 |
| Portfolioanalyse | | | | | US\$ | % des Gesamtvermögens |
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | | | | | 81.891.704 | 52,37 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | | | | | 58.110.804 | 37,16 |
| † Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente | | | | | 3.955.359 | 2,53 |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente | | | | | 281.732 | 0,18 |
| Anlagen insgesamt | | | | | 144.239.599 | 92,24 |

Global Equity Megatrends - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|---|-----------------------------------|--------------------|----------------------|
| Aktien 97,93 % (31. Dezember 2022: 100,15 %) | | | |
| Kanadischer Dollar | | | |
| 342.482 | Element Fleet Management Corp | 5.599.812 | 3,88 |
| Kanadischer Dollar insgesamt | | 5.599.812 | 3,88 |
| Britisches Pfund | | | |
| 1.867.832 | Pets at Home Group Plc | 7.576.699 | 5,24 |
| Britisches Pfund insgesamt | | 7.576.699 | 5,24 |
| US-Dollar | | | |
| 103.779 | Alibaba Group Holding Ltd ADR | 8.043.910 | 5,57 |
| 46.267 | Alphabet Inc Class A | 6.463.037 | 4,47 |
| 79.388 | Amdocs Ltd | 6.977.411 | 4,83 |
| 98.119 | ATI Inc | 4.461.471 | 3,09 |
| 208.596 | Corning Inc | 6.351.748 | 4,40 |
| 333.254 | Criteo SA ADR | 8.437.991 | 5,84 |
| 176.145 | Delta Air Lines Inc | 7.086.313 | 4,90 |
| 640.813 | Despegar.com Corp | 6.062.091 | 4,19 |
| 242.040 | Element Solutions Inc | 5.600.806 | 3,88 |
| 60.322 | Expedia Group Inc | 9.156.276 | 6,34 |
| 314.583 | Gen Digital Inc | 7.178.784 | 4,97 |
| 163.557 | ModivCare Inc | 7.194.873 | 4,98 |
| 14.601 | Nice Ltd ADR | 2.913.046 | 2,02 |
| 237.296 | Perrigo Co Plc | 7.636.185 | 5,28 |
| 157.093 | Scholastic Corp | 5.922.406 | 4,10 |
| 137.700 | Stericycle Inc | 6.824.412 | 4,72 |
| 23.440 | TE Connectivity Ltd | 3.293.320 | 2,28 |
| 9.665 | Tetra Tech Inc | 1.613.379 | 1,12 |
| 104.724 | Uber Technologies Inc | 6.447.857 | 4,46 |
| 149.433 | Vistra Corp | 5.756.159 | 3,98 |
| 554.945 | Zeta Global Holdings Corp Class A | 4.894.615 | 3,39 |
| US-Dollar insgesamt | | 128.316.090 | 88,81 |
| Aktien insgesamt * | | 141.492.601 | 97,93 |
| Anlagen insgesamt | | 141.492.601 | 97,93 |

Devisenterminkontrakte 0,00 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|----------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i> | | | | | | |
| 40.207 SGD | 30.060 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | 444 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | 444 | 0,00 |

Global Equity Megatrends - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|--------------------|------------------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 141.493.045 | 97,93 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | 141.493.045 | 97,93 |
| Sonstiges Nettovermögen | 2.989.811 | 2,07 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | 144.482.856 | 100,00 |

| Portfolioanalyse | US\$ | % des Gesamtver- mögens |
|---|--------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 141.492.601 | 95,72 |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente | 444 | 0,00 |
| Anlagen insgesamt | 141.493.045 | 95,72 |

Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|-----------------------|------------------|----------------------|
| Aktien 1,54 % (31. Dezember 2022: 1,33 %) | | | |
| US-Dollar | | | |
| 5.000 | McAfee LLC | 6.022.083 | 1,54 |
| Aktien insgesamt * | | 6.022.083 | 1,54 |

| Kapitalbetrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeitsdatum | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---|---------|------------------|---------------|----------------------|
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 5,92 % (31. Dezember 2022: 6,10 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 2.000.000 | AGL CLO 19 Ltd Series 2022-19X Class E | 13,33 % | 21.07.2035 | 2.001.634 | 0,51 |
| 2.500.000 | Aimco CDO Series 2021-16X Class D | 8,48 % | 17.01.2035 | 2.469.014 | 0,63 |
| 1.950.000 | CIFC Funding 2018-I Ltd Class D | 8,31 % | 18.04.2031 | 1.922.372 | 0,49 |
| 500.000 | CIFC Funding 2018-II Ltd Class C | 8,53 % | 20.04.2031 | 492.818 | 0,13 |
| 375.000 | COMM 2013-CCRE8 Mortgage Trust Class D | 3,60 % | 10.06.2046 | 341.396 | 0,09 |
| 745.000 | Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01 Class 1B1 | 8,44 % | 25.10.2041 | 752.356 | 0,19 |
| 520.000 | Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R02 Class 2B1 | 9,84 % | 25.01.2042 | 536.591 | 0,14 |
| 390.000 | Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R02 Class 2M2 | 8,34 % | 25.01.2042 | 395.876 | 0,10 |
| 187.000 | CSAIL 2018-C14 Commercial Mortgage Trust Class C | 4,90 % | 15.11.2051 | 149.319 | 0,04 |
| 1.000.000 | Dryden 93 CLO Ltd Series 2021-93X Class D | 8,53 % | 15.01.2034 | 979.817 | 0,25 |
| 191.000 | Eleven Madison Trust 2015-11MD Mortgage Trust Class A | 3,55 % | 10.09.2035 | 172.020 | 0,04 |
| 525.000 | Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 1B1 | 9,20 % | 25.10.2030 | 564.224 | 0,15 |
| 286.000 | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA6 Class B1 | 8,74 % | 25.10.2041 | 291.145 | 0,08 |
| 847.000 | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA7 Class B1 | 8,99 % | 25.11.2041 | 864.273 | 0,22 |
| 265.000 | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-HQA3 Class M2 | 7,44 % | 25.09.2041 | 261.907 | 0,07 |
| 180.000 | GS Mortgage Securities Trust 2015-GS1 Class AS | 4,04 % | 10.11.2048 | 162.023 | 0,04 |
| 359.000 | GS Mortgage Securities Trust 2016-GS4 Class B | 3,85 % | 10.11.2049 | 320.321 | 0,08 |
| 295.000 | Hilton USA Trust 2016-HHV Class C | 4,19 % | 05.11.2038 | 280.128 | 0,07 |
| 100.000 | Hilton USA Trust 2016-HHV Class D | 4,19 % | 05.11.2038 | 93.761 | 0,02 |
| 590.000 | Hilton USA Trust 2016-HHV Class E | 4,19 % | 05.11.2038 | 546.229 | 0,14 |
| 1.125.000 | Invesco CLO Ltd Series 2021-3X Class D | 8,67 % | 22.10.2034 | 1.094.676 | 0,28 |
| 365.000 | JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust Series 2016-NINE Class A | 2,85 % | 06.09.2038 | 337.474 | 0,09 |
| 130.000 | JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust Series 2016-NINE Class B | 2,85 % | 06.09.2038 | 115.176 | 0,03 |
| 65.000 | JP Morgan Mortgage Trust Series 2023-HE3 Class M2 | 7,84 % | 25.05.2054 | 65.162 | 0,02 |
| 160.000 | MetroNet Infrastructure Issuer LLC Series 2022-1A Class A2 | 6,35 % | 20.10.2052 | 157.657 | 0,04 |
| 580.000 | Morgan Stanley Capital I Trust 2017-H1 Class C | 4,28 % | 15.06.2050 | 484.741 | 0,13 |
| 279.000 | Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H4 Class C | 5,06 % | 15.12.2051 | 234.364 | 0,06 |
| 703.508 | OBX Trust Series 2023-NQM7 Class A1 | 6,84 % | 25.04.2063 | 717.682 | 0,18 |
| 500.000 | Octagon Investment Partners 35 Ltd Series 2018-1X Class C | 8,18 % | 20.01.2031 | 480.659 | 0,12 |
| 340.000 | Shops at Crystals Trust Series 2016-CSTL Class A | 3,13 % | 05.07.2036 | 317.390 | 0,08 |
| 12.884 | SoFi Professional Loan Program 2017-D LLC Class A2FX | 2,65 % | 25.09.2040 | 12.403 | 0,00 |
| 131.691 | SoFi Professional Loan Program 2017-E LLC Class B | 3,49 % | 26.11.2040 | 126.833 | 0,03 |
| 150.000 | Taco Bell Funding LLC Series 2016-1A Class A23 | 4,97 % | 25.05.2046 | 148.184 | 0,04 |

Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|---|---|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 5,92 % (31. Dezember 2022: 6,10 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 585.788 | Taco Bell Funding LLC Series 2018-1A Class A2II | 4,94 % | 25.11.2048 | 571.926 | 0,15 |
| 2.000.000 | TCW CLO Ltd Series 2018-1X Class D | 8,55 % | 25.04.2031 | 1.943.401 | 0,50 |
| 1.000.000 | Trinitas CLO VII Ltd Series 2017-7X Class D1R | 9,14 % | 25.01.2035 | 933.393 | 0,24 |
| 1.000.000 | Trinitas CLO XIX Ltd Series 2022-19X Class E | 13,38 % | 23.10.2033 | 941.672 | 0,24 |
| 390.000 | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS4 Class C | 4,68 % | 15.12.2048 | 358.529 | 0,09 |
| 550.000 | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS6 Class C | 4,39 % | 15.11.2049 | 479.673 | 0,12 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt ** | | | | 23.118.219 | 5,92 |
| Unternehmensanleihen 75,85 % (31. Dezember 2022: 80,14 %) | | | | | |
| Euro | | | | | |
| 350.000 | 888 Acquisitions Ltd** | 7,56 % | 15.07.2027 | 370.096 | 0,09 |
| 800.000 | Abertis Infraestructuras Finance BV* | 3,25 % | 29.12.2049 | 850.492 | 0,22 |
| 500.000 | Ahlstrom Holding 3 Oy* | 3,63 % | 04.02.2028 | 501.923 | 0,13 |
| 700.000 | Allwyn International AS** | 3,88 % | 15.02.2027 | 746.191 | 0,19 |
| 300.000 | Altice Financing SA** | 4,25 % | 15.08.2029 | 295.004 | 0,08 |
| 300.000 | Altice Finco SA* | 4,75 % | 15.01.2028 | 276.169 | 0,07 |
| 300.000 | Altice France Holding SA* | 8,00 % | 15.05.2027 | 191.068 | 0,05 |
| 200.000 | Altice France SA** | 4,25 % | 15.10.2029 | 176.625 | 0,05 |
| 800.000 | American Tower Corp* | 0,50 % | 15.01.2028 | 788.837 | 0,20 |
| 186.000 | APA Infrastructure Ltd* | 7,13 % | 09.11.2083 | 216.275 | 0,06 |
| 415.000 | Avis Budget Finance Plc** | 7,25 % | 31.07.2030 | 492.144 | 0,13 |
| 600.000 | Banco Santander SA* | 4,13 % | 29.12.2049 | 569.265 | 0,15 |
| 512.000 | Banjay Entertainment SASU** | 7,00 % | 01.05.2029 | 598.033 | 0,15 |
| 700.000 | Bayer AG* | 5,38 % | 25.03.2082 | 736.907 | 0,19 |
| 1.399.000 | BCP V Modular Services Finance Plc** | 6,75 % | 30.11.2029 | 1.273.625 | 0,33 |
| 400.000 | Benteler International AG* | 9,38 % | 15.05.2028 | 473.132 | 0,12 |
| 1.000.000 | Birkenstock Financing Sarl* | 5,25 % | 30.04.2029 | 1.101.710 | 0,28 |
| 900.000 | BPCE SA* | 5,13 % | 25.01.2035 | 1.025.007 | 0,26 |
| 500.000 | CECONOMY AG* | 1,75 % | 24.06.2026 | 481.336 | 0,12 |
| 500.000 | Cirsa Finance International Sarl* | 4,50 % | 15.03.2027 | 533.109 | 0,14 |
| 599.000 | Cirsa Finance International Sarl* | 10,38 % | 30.11.2027 | 723.286 | 0,19 |
| 1.400.000 | Clarios Global LP/Clarios US Finance Co** | 4,38 % | 15.05.2026 | 1.538.699 | 0,39 |
| 600.000 | Commerzbank AG* | 6,50 % | 29.12.2049 | 631.334 | 0,16 |
| 1.000.000 | Ctec II GmbH** | 5,25 % | 15.02.2030 | 992.555 | 0,25 |
| 801.000 | Dana Financing Luxembourg Sarl* | 8,50 % | 15.07.2031 | 970.652 | 0,25 |
| 600.000 | Deutsche Lufthansa AG* | 3,00 % | 29.05.2026 | 646.561 | 0,17 |
| 200.000 | Deutsche Lufthansa AG* | 3,50 % | 14.07.2029 | 215.653 | 0,06 |
| 1.200.000 | Digital Dutch Finco BV* | 1,25 % | 01.02.2031 | 1.111.333 | 0,28 |
| 1.000.000 | Dufry One BV** | 2,50 % | 15.10.2024 | 1.089.036 | 0,28 |

Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 75,85 % (31. Dezember 2022: 80,14 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Euro (Fortsetzung) | | | | | |
| 1.000.000 | Electricite de France SA* | 5,00 % | 29.12.2049 | 1.105.389 | 0,28 |
| 200.000 | Electricite de France SA* | 7,50 % | 29.12.2049 | 241.753 | 0,06 |
| 699.000 | Emerald Debt Merger Sub LLC* | 6,38 % | 15.12.2030 | 827.785 | 0,21 |
| 503.000 | Emeria SASU** | 3,38 % | 31.03.2028 | 478.578 | 0,12 |
| 794.000 | Energia Group Roi Financeco DAC** | 6,88 % | 31.07.2028 | 912.682 | 0,23 |
| 333.000 | Ephios Subco 3 Sarl** | 7,88 % | 31.01.2031 | 381.341 | 0,10 |
| 1.430.000 | Fastighets AB Balder* | 2,87 % | 02.06.2081 | 1.196.287 | 0,31 |
| 500.000 | Forvia SE* | 3,75 % | 15.06.2028 | 542.537 | 0,14 |
| 447.000 | Forvia SE* | 7,25 % | 15.06.2026 | 524.626 | 0,13 |
| 929.000 | Gruenthal GmbH** | 4,13 % | 15.05.2028 | 1.018.069 | 0,26 |
| 1.250.000 | Guala Closures SpA* | 3,25 % | 15.06.2028 | 1.302.619 | 0,33 |
| 1.300.000 | Heimstaden Bostad Treasury BV* | 0,75 % | 06.09.2029 | 948.644 | 0,24 |
| 615.000 | HSBC Holdings Plc* | 4,75 % | 29.12.2049 | 616.026 | 0,16 |
| 1.102.000 | IHO Verwaltungs GmbH* | 8,75 % | 15.05.2028 | 1.329.212 | 0,34 |
| 1.500.000 | Iliad Holding SASU** | 5,63 % | 15.10.2028 | 1.667.596 | 0,43 |
| 478.000 | INEOS Quattro Finance 2 Plc* | 8,50 % | 15.03.2029 | 558.725 | 0,14 |
| 500.000 | International Consolidated Airlines Group SA* | 3,75 % | 25.03.2029 | 535.429 | 0,14 |
| 350.000 | Intrum AB* | 4,88 % | 15.08.2025 | 362.665 | 0,09 |
| 501.000 | IPD 3 BV* | 8,00 % | 15.06.2028 | 592.213 | 0,15 |
| 1.102.000 | Jaguar Land Rover Automotive Plc* | 4,50 % | 15.07.2028 | 1.191.910 | 0,31 |
| 300.000 | Kapla Holding SAS* | 9,47 % | 15.07.2027 | 338.479 | 0,09 |
| 450.000 | Kronos International Inc** | 3,75 % | 15.09.2025 | 478.374 | 0,12 |
| 520.000 | LHMC Finco 2 Sarl* | 7,25 % | 02.10.2025 | 572.336 | 0,15 |
| 900.000 | Liberty Mutual Group Inc* | 4,63 % | 02.12.2030 | 1.042.587 | 0,27 |
| 1.500.000 | Lorca Telecom Bondco SA* | 4,00 % | 18.09.2027 | 1.621.250 | 0,42 |
| 752.000 | Lottomatica SpA** | 7,13 % | 01.06.2028 | 877.661 | 0,22 |
| 1.160.000 | Loxam SAS* | 5,75 % | 15.07.2027 | 1.264.864 | 0,32 |
| 200.000 | Loxam SAS* | 6,38 % | 31.05.2029 | 229.382 | 0,06 |
| 500.000 | Lune Holdings Sarl** | 5,63 % | 15.11.2028 | 452.052 | 0,12 |
| 986.000 | Motion Bondco DAC* | 4,50 % | 15.11.2027 | 992.209 | 0,25 |
| 480.000 | Motion Finco Sarl* | 7,38 % | 15.06.2030 | 543.319 | 0,14 |
| 700.000 | Olympus Water US Holding Corp* | 3,88 % | 01.10.2028 | 710.814 | 0,18 |
| 859.000 | Olympus Water US Holding Corp* | 5,38 % | 01.10.2029 | 814.364 | 0,21 |
| 226.000 | Paprec Holding SA** | 6,50 % | 17.11.2027 | 267.434 | 0,07 |
| 415.000 | Petroleos Mexicanos* | 4,88 % | 21.02.2028 | 400.712 | 0,10 |
| 500.000 | PEU Finance Plc* | 7,25 % | 01.07.2028 | 569.732 | 0,15 |
| 602.000 | Playtech Plc* | 5,88 % | 28.06.2028 | 664.437 | 0,17 |
| 1.000.000 | Schaeffler AG* | 3,38 % | 12.10.2028 | 1.072.653 | 0,27 |
| 400.000 | SES SA* | 2,88 % | 29.12.2049 | 403.035 | 0,10 |

Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 75,85 % (31. Dezember 2022: 80,14 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Euro (Fortsetzung) | | | | | |
| 135.158 | Summer BC Holdco A Sarl** | 9,25 % | 31.10.2027 | 133.964 | 0,03 |
| 350.000 | Summer BC Holdco B Sarl** | 5,75 % | 31.10.2026 | 371.278 | 0,09 |
| 750.000 | TeamSystem SpA* | 3,50 % | 15.02.2028 | 769.533 | 0,20 |
| 439.599 | Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH** | 6,00 % | 30.07.2026 | 485.982 | 0,12 |
| 1.250.000 | Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH** | 2,00 % | 15.07.2025 | 1.353.925 | 0,35 |
| 700.000 | Telecom Italia SpA** | 3,00 % | 30.09.2025 | 756.429 | 0,19 |
| 878.000 | Telecom Italia SpA* | 7,88 % | 31.07.2028 | 1.079.877 | 0,28 |
| 1.000.000 | Telefonica Europe BV* | 4,38 % | 29.12.2049 | 1.098.663 | 0,28 |
| 500.000 | Telefonica Europe BV* | 6,14 % | 29.12.2049 | 569.279 | 0,15 |
| 500.000 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV* | 3,75 % | 09.05.2027 | 533.611 | 0,14 |
| 307.000 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV* | 7,38 % | 15.09.2029 | 372.027 | 0,10 |
| 307.000 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV* | 7,88 % | 15.09.2031 | 385.181 | 0,10 |
| 450.000 | Titan Holdings II BV* | 5,13 % | 15.07.2029 | 428.131 | 0,11 |
| 630.000 | TK Elevator Holdco GmbH** | 6,63 % | 15.07.2028 | 644.500 | 0,16 |
| 200.000 | TMNL Holding BV** | 3,75 % | 15.01.2029 | 210.303 | 0,05 |
| 300.000 | United Group BV** | 4,63 % | 15.08.2028 | 314.995 | 0,08 |
| 800.000 | Verisure Holding AB* | 3,25 % | 15.02.2027 | 850.486 | 0,22 |
| 1.201.000 | Verisure Midholding AB* | 5,25 % | 15.02.2029 | 1.270.044 | 0,33 |
| 400.000 | Wp/ap Telecom Holdings III BV** | 5,50 % | 15.01.2030 | 404.706 | 0,10 |
| 900.000 | ZF Europe Finance BV* | 3,00 % | 23.10.2029 | 917.757 | 0,23 |
| 1.000.000 | ZF Finance GmbH* | 3,75 % | 21.09.2028 | 1.068.415 | 0,27 |
| Euro insgesamt | | | | 63.284.923 | 16,20 |
| Britisches Pfund | | | | | |
| 500.000 | AA Bond Co Ltd* | 6,50 % | 31.01.2026 | 608.956 | 0,16 |
| 400.000 | Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc* | 4,75 % | 15.07.2027 | 372.053 | 0,10 |
| 900.000 | Barclays Plc* | 6,37 % | 31.01.2031 | 1.192.103 | 0,31 |
| 500.000 | Bellis Acquisition Co Plc** | 3,25 % | 16.02.2026 | 593.248 | 0,15 |
| 700.000 | Castle UK Finco Plc** | 7,00 % | 15.05.2029 | 760.497 | 0,19 |
| 501.000 | Constellation Automotive Financing Plc* | 4,88 % | 15.07.2027 | 526.983 | 0,13 |
| 998.000 | CPUK Finance Ltd** | 6,50 % | 28.08.2026 | 1.233.892 | 0,32 |
| 750.000 | Encore Capital Group Inc* | 4,25 % | 01.06.2028 | 821.594 | 0,21 |
| 595.000 | Mobico Group Plc* | 4,25 % | 29.12.2049 | 671.676 | 0,17 |
| 700.000 | Nationwide Building Society* | 5,75 % | 29.12.2049 | 825.320 | 0,21 |
| 800.000 | NatWest Group Plc* | 5,13 % | 29.12.2049 | 918.643 | 0,23 |
| 581.000 | Pinnacle Bidco Plc* | 10,00 % | 11.10.2028 | 771.677 | 0,20 |
| 750.000 | Travis Perkins Plc* | 3,75 % | 17.02.2026 | 904.471 | 0,23 |
| 402.000 | TVL Finance Plc* | 10,25 % | 28.04.2028 | 533.951 | 0,14 |
| Britisches Pfund insgesamt | | | | 10.735.064 | 2,75 |

Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 75,85 % (31. Dezember 2022: 80,14 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 725.000 | 1011778 BC ULC/New Red Finance Inc** | 4,00 % | 15.10.2030 | 651.144 | 0,17 |
| 450.000 | Abu Dhabi Commercial Bank PJSC* | 5,38 % | 18.07.2028 | 457.133 | 0,12 |
| 257.000 | Abu Dhabi Commercial Bank PJSC** | 8,00 % | 29.12.2049 | 273.511 | 0,07 |
| 251.000 | Abu Dhabi National Energy Co PJSC* | 4,70 % | 24.04.2033 | 254.759 | 0,06 |
| 400.000 | Adani Green Energy Ltd* | 4,38 % | 08.09.2024 | 386.482 | 0,10 |
| 500.000 | Adani Ports & Special Economic Zone Ltd** | 4,38 % | 03.07.2029 | 438.948 | 0,11 |
| 875.000 | Adient Global Holdings Ltd** | 7,00 % | 15.04.2028 | 904.979 | 0,23 |
| 2.585.000 | AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust* | 3,30 % | 30.01.2032 | 2.250.701 | 0,58 |
| 297.000 | Agrosuper SA** | 4,60 % | 20.01.2032 | 255.637 | 0,07 |
| 1.170.000 | Ahead DB Holdings LLC** | 6,63 % | 01.05.2028 | 1.020.538 | 0,26 |
| 1.245.781 | Air Canada 2020-2 Class A Pass Through Trust** | 5,25 % | 01.04.2029 | 1.222.779 | 0,31 |
| 1.200.000 | Air Lease Corp* | 4,63 % | 01.10.2028 | 1.173.954 | 0,30 |
| 1.261.978 | Alaska Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust** | 4,80 % | 15.08.2027 | 1.228.118 | 0,31 |
| 1.780.000 | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC** | 6,50 % | 15.02.2028 | 1.802.380 | 0,46 |
| 282.228 | Alfa Desarrollo SpA** | 4,55 % | 27.09.2051 | 220.612 | 0,06 |
| 1.000.000 | Alfa SAB de CV** | 6,88 % | 25.03.2044 | 997.776 | 0,26 |
| 333.000 | Alibaba Group Holding Ltd* | 4,20 % | 06.12.2047 | 272.201 | 0,07 |
| 467.000 | Alibaba Group Holding Ltd* | 4,40 % | 06.12.2057 | 380.849 | 0,10 |
| 1.730.000 | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer** | 6,75 % | 15.04.2028 | 1.770.923 | 0,45 |
| 750.000 | Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp** | 6,00 % | 01.06.2029 | 612.224 | 0,16 |
| 229.000 | Ally Financial Inc** | 4,70 % | 29.12.2049 | 155.939 | 0,04 |
| 145.000 | Ally Financial Inc Series B** | 4,70 % | 29.12.2049 | 109.212 | 0,03 |
| 500.000 | Alsea SAB de CV** | 7,75 % | 14.12.2026 | 510.896 | 0,13 |
| 915.000 | Altice France Holding SA** | 6,00 % | 15.02.2028 | 440.302 | 0,11 |
| 1.210.000 | American Airlines Inc** | 7,25 % | 15.02.2028 | 1.224.937 | 0,31 |
| 2.615.000 | American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd** | 5,75 % | 20.04.2029 | 2.551.998 | 0,65 |
| 1.125.000 | AmWINS Group Inc** | 4,88 % | 30.06.2029 | 1.028.879 | 0,26 |
| 2.960.000 | APX Group Inc** | 5,75 % | 15.07.2029 | 2.763.275 | 0,71 |
| 785.000 | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc** | 3,25 % | 01.09.2028 | 687.643 | 0,18 |
| 365.000 | Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc** | 5,25 % | 15.08.2027 | 283.985 | 0,07 |
| 1.425.000 | Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp** | 5,88 % | 30.06.2029 | 1.327.285 | 0,34 |
| 1.620.000 | Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp** | 8,25 % | 31.12.2028 | 1.631.309 | 0,42 |
| 850.000 | AssuredPartners Inc** | 5,63 % | 15.01.2029 | 794.460 | 0,20 |
| 2.007.000 | AT&T Inc** | 3,65 % | 15.09.2059 | 1.440.156 | 0,37 |
| 985.000 | AthenaHealth Group Inc** | 6,50 % | 15.02.2030 | 894.885 | 0,23 |
| 1.070.000 | Avient Corp** | 7,13 % | 01.08.2030 | 1.113.762 | 0,28 |
| 175.000 | Azul Secured Finance LLP** | 10,88 % | 28.05.2030 | 144.827 | 0,04 |
| 725.000 | Banco Davivienda SA** | 6,65 % | 29.12.2049 | 519.281 | 0,13 |
| 300.000 | Banco de Bogota SA* | 6,25 % | 12.05.2026 | 296.440 | 0,08 |
| 500.000 | Banco de Credito e Inversiones SA** | 2,88 % | 14.10.2031 | 424.340 | 0,11 |

Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 75,85 % (31. Dezember 2022: 80,14 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 520.000 | Banco do Brasil SA** | 6,25 % | 18.04.2030 | 541.468 | 0,14 |
| 300.000 | Banco Mercantil del Norte SA** | 6,63 % | 29.12.2049 | 255.600 | 0,07 |
| 600.000 | Bangkok Bank PCL** | 5,00 % | 29.12.2049 | 574.992 | 0,15 |
| 300.000 | Bank Hapoalim BM* | 3,26 % | 21.01.2032 | 260.787 | 0,07 |
| 905.000 | Bank of America Corp** | 5,08 % | 20.01.2027 | 903.383 | 0,23 |
| 750.000 | Barclays Plc* | 4,38 % | 29.12.2049 | 584.929 | 0,15 |
| 2.340.000 | Bath & Body Works Inc** | 6,63 % | 01.10.2030 | 2.393.099 | 0,61 |
| 400.000 | Bidvest Group UK Plc* | 3,63 % | 23.09.2026 | 372.000 | 0,10 |
| 410.000 | BOC Aviation USA Corp** | 4,88 % | 03.05.2033 | 401.692 | 0,10 |
| 2.550.000 | Boeing Co* | 5,81 % | 01.05.2050 | 2.642.441 | 0,68 |
| 695.000 | Borr IHC Ltd/Borr Finance LLC 144A** | 10,00 % | 15.11.2028 | 726.275 | 0,19 |
| 500.000 | Borr IHC Ltd/Borr Finance LLC** | 10,00 % | 15.11.2028 | 522.500 | 0,13 |
| 1.600.000 | BPCE SA** | 3,12 % | 19.10.2032 | 1.306.068 | 0,33 |
| 2.400.000 | Broadcom Inc** | 3,19 % | 15.11.2036 | 1.946.175 | 0,50 |
| 385.000 | BroadStreet Partners Inc** | 5,88 % | 15.04.2029 | 359.699 | 0,09 |
| 305.000 | Buckeye Partners LP** | 5,85 % | 15.11.2043 | 247.556 | 0,06 |
| 605.000 | Caesars Entertainment Inc** | 4,63 % | 15.10.2029 | 546.458 | 0,14 |
| 1.085.000 | Caesars Entertainment Inc** | 8,13 % | 01.07.2027 | 1.112.976 | 0,28 |
| 685.000 | Calpine Corp** | 5,00 % | 01.02.2031 | 628.848 | 0,16 |
| 980.000 | Calpine Corp** | 5,13 % | 15.03.2028 | 940.215 | 0,24 |
| 1.500.000 | Camelot Return Merger Sub Inc** | 8,75 % | 01.08.2028 | 1.524.486 | 0,39 |
| 742.000 | Canacol Energy Ltd** | 5,75 % | 24.11.2028 | 541.836 | 0,14 |
| 261.000 | Capital One Financial Corp** | 3,95 % | 29.12.2049 | 209.828 | 0,05 |
| 570.000 | Carnival Corp** | 7,63 % | 01.03.2026 | 580.662 | 0,15 |
| 1.370.000 | Carnival Holdings Bermuda Ltd** | 10,38 % | 01.05.2028 | 1.492.196 | 0,38 |
| 626.000 | CAS Capital No 1 Ltd* | 4,00 % | 29.12.2049 | 541.240 | 0,14 |
| 1.930.000 | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp** | 5,00 % | 01.02.2028 | 1.848.096 | 0,47 |
| 850.000 | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp** | 5,38 % | 01.06.2029 | 802.384 | 0,21 |
| 2.000.000 | CDW LLC/CDW Finance Corp** | 3,28 % | 01.12.2028 | 1.837.126 | 0,47 |
| 200.000 | Cemex SAB de CV** | 5,13 % | 29.12.2049 | 189.836 | 0,05 |
| 500.000 | Cemex SAB de CV** | 5,45 % | 19.11.2029 | 493.469 | 0,13 |
| 445.000 | Cemex SAB de CV** | 9,13 % | 29.12.2049 | 474.481 | 0,12 |
| 1.595.000 | Centene Corp* | 2,50 % | 01.03.2031 | 1.331.061 | 0,34 |
| 333.000 | Central American Bottling Corp/CBC Bottling Holdco SL/Beliv Holdco SL** | 5,25 % | 27.04.2029 | 313.066 | 0,08 |
| 1.670.000 | Chart Industries Inc** | 7,50 % | 01.01.2030 | 1.747.650 | 0,45 |
| 870.000 | Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital** | 4,80 % | 01.03.2050 | 674.559 | 0,17 |
| 1.550.000 | Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital** | 5,75 % | 01.04.2048 | 1.377.656 | 0,35 |
| 1.685.000 | Cheniere Energy Partners LP** | 3,25 % | 31.01.2032 | 1.437.738 | 0,37 |
| 670.000 | Churchill Downs Inc** | 4,75 % | 15.01.2028 | 642.544 | 0,16 |
| 340.000 | Churchill Downs Inc** | 6,75 % | 01.05.2031 | 345.503 | 0,09 |

Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 75,85 % (31. Dezember 2022: 80,14 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 905.000 | Citigroup Inc** | 5,61 % | 29.09.2026 | 912.263 | 0,23 |
| 1.310.000 | Civitas Resources Inc** | 8,63 % | 01.11.2030 | 1.390.653 | 0,36 |
| 625.000 | Civitas Resources Inc** | 8,75 % | 01.07.2031 | 666.123 | 0,17 |
| 1.935.000 | CommScope Technologies LLC** | 5,00 % | 15.03.2027 | 807.253 | 0,21 |
| 400.000 | Compania de Minas Buenaventura SAA** | 5,50 % | 23.07.2026 | 382.217 | 0,10 |
| 3.216.000 | Comstock Resources Inc** | 6,75 % | 01.03.2029 | 2.945.123 | 0,75 |
| 410.000 | Coty Inc/HFC Prestige Products Inc/HFC Prestige International US LLC** | 4,75 % | 15.01.2029 | 391.400 | 0,10 |
| 1.485.000 | CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC** | 5,50 % | 15.06.2031 | 1.409.279 | 0,36 |
| 195.000 | Crown Castle Towers LLC** | 4,24 % | 15.07.2028 | 185.180 | 0,05 |
| 1.510.000 | CSC Holdings LLC** | 4,13 % | 01.12.2030 | 1.150.499 | 0,29 |
| 2.165.000 | CSC Holdings LLC** | 4,63 % | 01.12.2030 | 1.306.297 | 0,33 |
| 300.000 | CSC Holdings LLC** | 5,25 % | 01.06.2024 | 293.892 | 0,08 |
| 500.000 | CSN Resources SA** | 4,63 % | 10.06.2031 | 409.303 | 0,10 |
| 220.000 | CSN Resources SA** | 8,88 % | 05.12.2030 | 229.464 | 0,06 |
| 355.000 | Cushman & Wakefield US Borrower LLC** | 8,88 % | 01.09.2031 | 376.486 | 0,10 |
| 785.000 | Dana Inc* | 4,50 % | 15.02.2032 | 683.888 | 0,17 |
| 1.150.000 | Dell International LLC/EMC Corp* | 6,20 % | 15.07.2030 | 1.234.459 | 0,32 |
| 2.125.000 | Discovery Communications LLC** | 4,00 % | 15.09.2055 | 1.514.642 | 0,39 |
| 820.000 | DT Midstream Inc** | 4,38 % | 15.06.2031 | 740.697 | 0,19 |
| 350.000 | Eastern & Southern African Trade & Development Bank* | 4,13 % | 30.06.2028 | 303.275 | 0,08 |
| 735.000 | Ecopetrol SA** | 4,63 % | 02.11.2031 | 624.310 | 0,16 |
| 200.000 | Ecopetrol SA* | 8,88 % | 13.01.2033 | 217.531 | 0,06 |
| 550.000 | Edison International** | 5,00 % | 29.12.2049 | 513.482 | 0,13 |
| 400.000 | EIG Pearl Holdings Sarl* | 4,39 % | 30.11.2046 | 322.160 | 0,08 |
| 305.000 | Emerald Debt Merger Sub LLC** | 6,63 % | 15.12.2030 | 311.899 | 0,08 |
| 400.000 | Emirates NBD Bank PJSC** | 4,25 % | 29.12.2049 | 361.000 | 0,09 |
| 720.000 | Emirates NBD Bank PJSC* | 5,88 % | 11.10.2028 | 745.229 | 0,19 |
| 438.000 | Empresa Nacional del Petroleo** | 3,45 % | 16.09.2031 | 369.631 | 0,09 |
| 241.773 | Energian Israel Finance Ltd** | 4,88 % | 30.03.2026 | 223.459 | 0,06 |
| 1.810.000 | Energizer Holdings Inc** | 4,75 % | 15.06.2028 | 1.675.313 | 0,43 |
| 500.000 | ENN Energy Holdings Ltd** | 2,63 % | 17.09.2030 | 428.238 | 0,11 |
| 2.400.000 | EPR Properties** | 3,60 % | 15.11.2031 | 1.992.761 | 0,51 |
| 425.000 | EQM Midstream Partners LP** | 4,75 % | 15.01.2031 | 396.095 | 0,10 |
| 390.000 | EQM Midstream Partners LP* | 5,50 % | 15.07.2028 | 386.670 | 0,10 |
| 1.145.000 | EQM Midstream Partners LP** | 7,50 % | 01.06.2030 | 1.232.202 | 0,32 |
| 900.000 | EquipmentShare.com Inc** | 9,00 % | 15.05.2028 | 927.090 | 0,24 |
| 299.000 | First Abu Dhabi Bank PJSC* | 6,32 % | 04.04.2034 | 308.426 | 0,08 |
| 455.000 | First Quantum Minerals Ltd** | 6,88 % | 01.03.2026 | 407.883 | 0,10 |
| 150.000 | First Quantum Minerals Ltd** | 8,63 % | 01.06.2031 | 127.313 | 0,03 |
| 485.000 | FMG Resources August 2006 Pty Ltd** | 5,88 % | 15.04.2030 | 481.231 | 0,12 |

Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 75,85 % (31. Dezember 2022: 80,14 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 3.405.000 | Ford Motor Credit Co LLC* | 7,20 % | 10.06.2030 | 3.630.226 | 0,93 |
| 600.000 | Franshion Brilliant Ltd* | 4,25 % | 23.07.2029 | 390.880 | 0,10 |
| 1.050.000 | Frontier Communications Holdings LLC** | 5,00 % | 01.05.2028 | 971.352 | 0,25 |
| 475.000 | Frontier Communications Holdings LLC** | 5,88 % | 15.10.2027 | 459.292 | 0,12 |
| 1.000.000 | FS Luxembourg Sarl** | 10,00 % | 15.12.2025 | 1.026.211 | 0,26 |
| 403.000 | Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd* | 2,63 % | 31.03.2036 | 333.316 | 0,09 |
| 1.600.000 | General Motors Co* | 5,00 % | 01.04.2035 | 1.528.724 | 0,39 |
| 1.000.000 | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp* | 8,00 % | 15.01.2027 | 1.017.305 | 0,26 |
| 455.000 | Global Infrastructure Solutions Inc** | 7,50 % | 15.04.2032 | 420.319 | 0,11 |
| 905.000 | Goldman Sachs Group Inc** | 1,43 % | 09.03.2027 | 834.731 | 0,21 |
| 1.565.000 | Goodyear Tire & Rubber Co** | 5,25 % | 15.07.2031 | 1.421.889 | 0,36 |
| 1.170.000 | Greenko Power II Ltd* | 4,30 % | 13.12.2028 | 1.057.680 | 0,27 |
| 200.000 | Greensaif Pipelines Bidco Sarl* | 6,51 % | 23.02.2042 | 211.505 | 0,05 |
| 500.000 | GTCR W-2 Merger Sub LLC** | 7,50 % | 15.01.2031 | 528.686 | 0,14 |
| 339.289 | Guara Norte Sarl** | 5,20 % | 15.06.2034 | 309.466 | 0,08 |
| 585.000 | Harvest Midstream I LP** | 7,50 % | 01.09.2028 | 582.174 | 0,15 |
| 1.600.000 | HCA Inc* | 5,25 % | 15.06.2049 | 1.489.386 | 0,38 |
| 614.000 | HDFC Bank Ltd** | 3,70 % | 29.12.2049 | 560.305 | 0,14 |
| 280.000 | Howard Midstream Energy Partners LLC** | 8,88 % | 15.07.2028 | 294.182 | 0,08 |
| 905.000 | HSBC Holdings Plc* | 7,39 % | 03.11.2028 | 970.324 | 0,25 |
| 445.000 | Huarong Finance 2017 Co Ltd* | 4,25 % | 07.11.2027 | 406.739 | 0,10 |
| 1.100.000 | Huarong Finance 2019 Co Ltd* | 4,50 % | 29.05.2029 | 975.535 | 0,25 |
| 1.550.000 | HUB International Ltd** | 7,25 % | 15.06.2030 | 1.638.203 | 0,42 |
| 1.094.000 | Hudbay Minerals Inc** | 6,13 % | 01.04.2029 | 1.074.104 | 0,27 |
| 252.000 | Huntington Bancshares Inc** | 4,45 % | 29.12.2049 | 221.631 | 0,06 |
| 68.000 | Huntington Bancshares Inc** | 5,63 % | 29.12.2049 | 61.734 | 0,02 |
| 200.000 | Hyundai Capital America** | 5,68 % | 26.06.2028 | 204.000 | 0,05 |
| 680.000 | IHO Verwaltungs GmbH** | 4,75 % | 15.09.2026 | 652.096 | 0,17 |
| 500.000 | IHS Holding Ltd** | 5,63 % | 29.11.2026 | 436.493 | 0,11 |
| 715.000 | Imola Merger Corp** | 4,75 % | 15.05.2029 | 680.214 | 0,17 |
| 600.000 | Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT** | 3,54 % | 27.04.2032 | 519.689 | 0,13 |
| 630.000 | INEOS Finance Plc* | 6,75 % | 15.05.2028 | 619.433 | 0,16 |
| 250.000 | ING Groep NV** | 3,88 % | 29.12.2049 | 203.437 | 0,05 |
| 1.005.000 | Intelligent Packaging Ltd Finco Inc/Intelligent Packaging Ltd Co-Issuer LLC** | 6,00 % | 15.09.2028 | 938.740 | 0,24 |
| 350.000 | Investment Energy Resources Ltd* | 6,25 % | 26.04.2029 | 330.955 | 0,08 |
| 365.000 | Iron Mountain Inc** | 5,63 % | 15.07.2032 | 346.391 | 0,09 |
| 950.000 | ITT Holdings LLC** | 6,50 % | 01.08.2029 | 841.382 | 0,22 |
| 670.000 | Jaguar Land Rover Automotive Plc* | 5,88 % | 15.01.2028 | 662.026 | 0,17 |
| 1.195.000 | JELD-WEN Inc** | 4,88 % | 15.12.2027 | 1.130.530 | 0,29 |
| 500.000 | JSW Steel Ltd* | 5,05 % | 05.04.2032 | 431.770 | 0,11 |

Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 75,85 % (31. Dezember 2022: 80,14 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 400.000 | KazMunayGas National Co JSC* | 3,50 % | 14.04.2033 | 333.430 | 0,09 |
| 800.000 | KazMunayGas National Co JSC* | 6,38 % | 24.10.2048 | 753.148 | 0,19 |
| 2.400.000 | KB Home** | 7,25 % | 15.07.2030 | 2.487.271 | 0,64 |
| 1.000.000 | Kinder Morgan Energy Partners LP* | 5,50 % | 01.03.2044 | 949.172 | 0,24 |
| 500.000 | Klabin Austria GmbH** | 3,20 % | 12.01.2031 | 419.201 | 0,11 |
| 500.000 | Kosmos Energy Ltd* | 7,13 % | 04.04.2026 | 477.153 | 0,12 |
| 555.000 | Leeward Renewable Energy Operations LLC** | 4,25 % | 01.07.2029 | 484.127 | 0,12 |
| 450.000 | Lenovo Group Ltd* | 3,42 % | 02.11.2030 | 397.675 | 0,10 |
| 410.000 | Level 3 Financing Inc** | 4,63 % | 15.09.2027 | 247.792 | 0,06 |
| 535.000 | Level 3 Financing Inc** | 10,50 % | 15.05.2030 | 511.125 | 0,13 |
| 250.000 | Leviathan Bond Ltd* | 6,75 % | 30.06.2030 | 228.889 | 0,06 |
| 325.000 | Light & Wonder International Inc** | 7,50 % | 01.09.2031 | 339.213 | 0,09 |
| 350.000 | Longfor Group Holdings Ltd** | 3,95 % | 16.09.2029 | 162.236 | 0,04 |
| 1.775.000 | Macy's Retail Holdings LLC** | 5,88 % | 15.03.2030 | 1.688.797 | 0,43 |
| 735.000 | Madison IAQ LLC** | 5,88 % | 30.06.2029 | 648.501 | 0,17 |
| 600.000 | MARB BondCo Plc* | 3,95 % | 29.01.2031 | 487.905 | 0,12 |
| 1.350.000 | Mauser Packaging Solutions Holding Co** | 7,88 % | 15.08.2026 | 1.375.084 | 0,35 |
| 676.376 | MC Brazil Downstream Trading Sarl** | 7,25 % | 30.06.2031 | 530.915 | 0,14 |
| 910.000 | McAfee Corp** | 7,38 % | 15.02.2030 | 832.274 | 0,21 |
| 720.000 | McGraw-Hill Education Inc** | 8,00 % | 01.08.2029 | 670.291 | 0,17 |
| 201.000 | MDGH GMTN RSC Ltd* | 5,88 % | 01.05.2034 | 219.752 | 0,06 |
| 700.000 | Medco Oak Tree Pte Ltd** | 7,38 % | 14.05.2026 | 695.912 | 0,18 |
| 1.595.000 | Medline Borrower LP** | 3,88 % | 01.04.2029 | 1.444.040 | 0,37 |
| 300.000 | Melco Resorts Finance Ltd** | 5,63 % | 17.07.2027 | 281.435 | 0,07 |
| 355.000 | Mersin Uluslararası Liman Isletmeciligi AS* | 8,25 % | 15.11.2028 | 371.142 | 0,09 |
| 1.635.000 | Midwest Gaming Borrower LLC/Midwest Gaming Finance Corp** | 4,88 % | 01.05.2029 | 1.522.357 | 0,39 |
| 300.000 | Minerva Luxembourg SA** | 8,88 % | 13.09.2033 | 317.713 | 0,08 |
| 400.000 | Minsur SA** | 4,50 % | 28.10.2031 | 353.972 | 0,09 |
| 330.000 | Molina Healthcare Inc** | 3,88 % | 15.11.2030 | 297.010 | 0,08 |
| 905.000 | Morgan Stanley** | 4,21 % | 20.04.2028 | 884.985 | 0,23 |
| 1.150.000 | MPLX LP* | 5,50 % | 15.02.2049 | 1.113.859 | 0,28 |
| 1.770.000 | MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp* | 5,00 % | 15.10.2027 | 1.447.403 | 0,37 |
| 385.000 | Nabors Industries Inc** | 7,38 % | 15.05.2027 | 377.586 | 0,10 |
| 1.600.000 | NatWest Group Plc* | 3,03 % | 28.11.2035 | 1.328.584 | 0,34 |
| 340.000 | Neptune Bidco US Inc** | 9,29 % | 15.04.2029 | 317.328 | 0,08 |
| 2.945.000 | New Fortress Energy Inc** | 6,50 % | 30.09.2026 | 2.831.052 | 0,72 |
| 820.000 | Newfold Digital Holdings Group Inc** | 6,00 % | 15.02.2029 | 620.355 | 0,16 |
| 500.000 | Nexa Resources SA** | 5,38 % | 04.05.2027 | 488.499 | 0,12 |
| 670.000 | Northwest Fiber LLC/Northwest Fiber Finance Sub Inc** | 10,75 % | 01.06.2028 | 677.175 | 0,17 |
| 555.000 | NRG Energy Inc** | 3,38 % | 15.02.2029 | 490.811 | 0,13 |

Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 75,85 % (31. Dezember 2022: 80,14 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 118.000 | NRG Energy Inc** | 3,88 % | 15.02.2032 | 101.153 | 0,03 |
| 595.000 | NRG Energy Inc** | 10,25 % | 29.12.2049 | 620.038 | 0,16 |
| 265.000 | Olympus Water US Holding Corp** | 9,75 % | 15.11.2028 | 281.600 | 0,07 |
| 1.465.000 | OneMain Finance Corp* | 3,88 % | 15.09.2028 | 1.297.352 | 0,33 |
| 400.000 | OneMain Finance Corp* | 9,00 % | 15.01.2029 | 423.232 | 0,11 |
| 272.000 | Oryx Funding Ltd** | 5,80 % | 03.02.2031 | 273.428 | 0,07 |
| 300.000 | Oztel Holdings SPC Ltd* | 6,63 % | 24.04.2028 | 314.363 | 0,08 |
| 475.000 | Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer** | 5,88 % | 01.10.2028 | 467.588 | 0,12 |
| 500.000 | Periama Holdings LLC* | 5,95 % | 19.04.2026 | 493.870 | 0,13 |
| 690.000 | Permian Resources Operating LLC** | 7,00 % | 15.01.2032 | 712.368 | 0,18 |
| 635.000 | Petrobras Global Finance BV* | 5,50 % | 10.06.2051 | 535.919 | 0,14 |
| 429.000 | Petrobras Global Finance BV* | 6,50 % | 03.07.2033 | 435.968 | 0,11 |
| 1.475.000 | PetSmart Inc/PetSmart Finance Corp** | 7,75 % | 15.02.2029 | 1.436.131 | 0,37 |
| 475.000 | Pilgrim's Pride Corp** | 3,50 % | 01.03.2032 | 402.190 | 0,10 |
| 520.000 | Pilgrim's Pride Corp** | 6,25 % | 01.07.2033 | 535.691 | 0,14 |
| 1.020.000 | Pilgrim's Pride Corp** | 6,88 % | 15.05.2034 | 1.102.450 | 0,28 |
| 220.000 | PNC Financial Services Group Inc** | 3,40 % | 29.12.2049 | 176.533 | 0,04 |
| 830.000 | PNC Financial Services Group Inc** | 4,76 % | 26.01.2027 | 823.788 | 0,21 |
| 500.000 | Power Finance Corp Ltd* | 4,50 % | 18.06.2029 | 485.189 | 0,12 |
| 1.350.000 | Presidio Holdings Inc** | 8,25 % | 01.02.2028 | 1.365.258 | 0,35 |
| 295.000 | Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc** | 5,75 % | 15.04.2026 | 296.784 | 0,08 |
| 3.170.000 | Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc** | 6,25 % | 15.01.2028 | 3.153.987 | 0,81 |
| 500.000 | Prosus NV* | 3,83 % | 08.02.2051 | 314.498 | 0,08 |
| 1.240.000 | Rackspace Technology Global Inc** | 3,50 % | 15.02.2028 | 499.230 | 0,13 |
| 1.190.000 | Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp** | 5,25 % | 15.04.2030 | 889.683 | 0,23 |
| 409.000 | Rede D'or Finance Sarl** | 4,50 % | 22.01.2030 | 371.069 | 0,09 |
| 649.000 | Reliance Industries Ltd* | 3,63 % | 12.01.2052 | 476.935 | 0,12 |
| 450.000 | ReNew Wind Energy AP2/ReNew Power Pvt Ltd other 9 Subsidiaries** | 4,50 % | 14.07.2028 | 400.323 | 0,10 |
| 185.000 | RingCentral Inc** | 8,50 % | 15.08.2030 | 189.363 | 0,05 |
| 825.000 | Ritchie Bros Holdings Inc** | 7,75 % | 15.03.2031 | 880.572 | 0,23 |
| 235.000 | Rockcliff Energy II LLC** | 5,50 % | 15.10.2029 | 222.417 | 0,06 |
| 700.000 | Rogers Communications Inc** | 3,80 % | 15.03.2032 | 644.378 | 0,16 |
| 360.000 | Royal Caribbean Cruises Ltd** | 5,50 % | 01.04.2028 | 355.638 | 0,09 |
| 905.000 | Royal Caribbean Cruises Ltd** | 7,25 % | 15.01.2030 | 945.730 | 0,24 |
| 700.000 | Samarco Mineracao SA** | 9,50 % | 30.06.2031 | 588.700 | 0,15 |
| 1.000.000 | Sasol Financing USA LLC* | 6,50 % | 27.09.2028 | 953.733 | 0,24 |
| 327.000 | Sasol Financing USA LLC* | 8,75 % | 03.05.2029 | 333.972 | 0,09 |
| 700.000 | SEPLAT Energy Plc* | 7,75 % | 01.04.2026 | 645.400 | 0,17 |
| 2.000 | Service Properties Trust** | 3,95 % | 15.01.2028 | 1.641 | 0,00 |
| 705.000 | Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp** | 4,75 % | 01.04.2029 | 652.294 | 0,17 |

Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 75,85 % (31. Dezember 2022: 80,14 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 318.000 | Shelf Drilling Holdings Ltd** | 9,63 % | 15.04.2029 | 311.420 | 0,08 |
| 1.300.000 | SierraCol Energy Andina LLC** | 6,00 % | 15.06.2028 | 1.095.172 | 0,28 |
| 402.000 | Sitios Latinoamerica SAB de CV** | 5,38 % | 04.04.2032 | 374.080 | 0,10 |
| 266.000 | SK Hynix Inc* | 6,38 % | 17.01.2028 | 274.934 | 0,07 |
| 225.000 | SK Hynix Inc* | 6,50 % | 17.01.2033 | 237.724 | 0,06 |
| 380.000 | Solaris Midstream Holdings LLC** | 7,63 % | 01.04.2026 | 385.587 | 0,10 |
| 483.000 | Standard Chartered Plc* | 6,30 % | 06.07.2034 | 507.589 | 0,13 |
| 1.555.000 | Standard Industries Inc** | 3,38 % | 15.01.2031 | 1.340.038 | 0,34 |
| 2.480.000 | Summit Midstream Holdings LLC/Summit Midstream Finance Corp** | 9,00 % | 15.10.2026 | 2.462.850 | 0,63 |
| 990.000 | Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp** | 6,00 % | 31.12.2030 | 921.717 | 0,24 |
| 295.000 | Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp** | 6,00 % | 01.09.2031 | 273.278 | 0,07 |
| 1.155.000 | Team Health Holdings Inc† | 13,50 % | 30.06.2028 | 1.131.900 | 0,29 |
| 600.000 | Telecomunicaciones Digitales SA** | 4,50 % | 30.01.2030 | 517.740 | 0,13 |
| 750.000 | Tencent Holdings Ltd* | 3,24 % | 03.06.2050 | 500.780 | 0,13 |
| 1.515.000 | Tenet Healthcare Corp** | 6,13 % | 01.10.2028 | 1.512.046 | 0,39 |
| 200.000 | Thaioil Treasury Center Co Ltd* | 3,75 % | 18.06.2050 | 141.107 | 0,04 |
| 500.000 | Thaioil Treasury Center Co Ltd* | 3,75 % | 18.06.2050 | 352.767 | 0,09 |
| 615.000 | TMS International Corp** | 6,25 % | 15.04.2029 | 508.208 | 0,13 |
| 282.000 | Total Play Telecomunicaciones SA de CV* | 6,38 % | 20.09.2028 | 114.924 | 0,03 |
| 2.390.000 | TransDigm Inc** | 6,75 % | 15.08.2028 | 2.448.153 | 0,63 |
| 200.000 | Transnet SOC Ltd* | 8,25 % | 06.02.2028 | 201.973 | 0,05 |
| 820.000 | Trivium Packaging Finance BV† | 8,50 % | 15.08.2027 | 804.936 | 0,21 |
| 45.000 | Truist Financial Corp** | 5,10 % | 29.12.2049 | 41.004 | 0,01 |
| 830.000 | Truist Financial Corp** | 6,05 % | 08.06.2027 | 845.034 | 0,22 |
| 400.000 | Trust Fibra Uno** | 6,95 % | 30.01.2044 | 345.520 | 0,09 |
| 300.000 | Turk Telekomunikasyon AS* | 4,88 % | 19.06.2024 | 295.125 | 0,08 |
| 300.000 | Turkcell Iletisim Hizmetleri AS* | 5,80 % | 11.04.2028 | 285.288 | 0,07 |
| 200.000 | Turkiye Petrol Rafinerileri AS* | 4,50 % | 18.10.2024 | 196.978 | 0,05 |
| 1.293.967 | United Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust** | 5,88 % | 15.10.2027 | 1.311.558 | 0,34 |
| 605.000 | United Airlines Inc** | 4,38 % | 15.04.2026 | 589.990 | 0,15 |
| 1.410.000 | United Rentals North America Inc* | 5,25 % | 15.01.2030 | 1.389.930 | 0,36 |
| 855.000 | Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC** | 10,50 % | 15.02.2028 | 867.534 | 0,22 |
| 220.000 | US Foods Inc** | 6,88 % | 15.09.2028 | 226.734 | 0,06 |
| 255.000 | US Foods Inc** | 7,25 % | 15.01.2032 | 266.210 | 0,07 |
| 635.000 | Valaris Ltd** | 8,38 % | 30.04.2030 | 651.126 | 0,17 |
| 645.000 | Vale Overseas Ltd* | 6,88 % | 21.11.2036 | 704.455 | 0,18 |
| 1.000.000 | Vedanta Resources Finance II Plc† | 8,95 % | 11.03.2025 | 744.540 | 0,19 |
| 500.000 | Vedanta Resources Finance II Plc† | 13,88 % | 21.01.2024 | 441.890 | 0,11 |
| 890.000 | Venture Global LNG Inc** | 8,38 % | 01.06.2031 | 890.879 | 0,23 |
| 410.000 | Venture Global LNG Inc** | 9,50 % | 01.02.2029 | 434.105 | 0,11 |

Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 75,85 % (31. Dezember 2022: 80,14 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 245.000 | Venture Global LNG Inc** | 9,88 % | 01.02.2032 | 255.355 | 0,07 |
| 965.000 | VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc** | 6,38 % | 01.02.2030 | 674.710 | 0,17 |
| 735.000 | VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc** | 9,50 % | 01.06.2028 | 622.940 | 0,16 |
| 2.115.000 | Vistra Corp** | 7,00 % | 29.12.2049 | 2.086.173 | 0,53 |
| 1.025.000 | Vistra Operations Co LLC** | 7,75 % | 15.10.2031 | 1.065.322 | 0,27 |
| 200.000 | VTR Finance NV** | 6,38 % | 15.07.2028 | 52.362 | 0,01 |
| 340.000 | WE Soda Investments Holding Plc** | 9,50 % | 06.10.2028 | 351.832 | 0,09 |
| 905.000 | Wells Fargo & Co** | 4,54 % | 15.08.2026 | 895.900 | 0,23 |
| 1.205.000 | White Cap Buyer LLC** | 6,88 % | 15.10.2028 | 1.167.960 | 0,30 |
| 405.000 | Windsor Holdings III LLC** | 8,50 % | 15.06.2030 | 423.743 | 0,11 |
| 500.000 | XP Inc** | 3,25 % | 01.07.2026 | 469.183 | 0,12 |
| 660.000 | Yapi ve Kredi Bankasi AS** | 9,25 % | 16.10.2028 | 700.791 | 0,18 |
| 300.000 | YPF SA* | 6,95 % | 21.07.2027 | 268.732 | 0,07 |
| 700.000 | YPF SA* | 8,50 % | 28.07.2025 | 676.616 | 0,17 |
| US-Dollar insgesamt | | | | 222.253.475 | 56,90 |
| Unternehmensanleihen insgesamt | | | | 296.273.462 | 75,85 |
| Staatsanleihen 3,94 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) | | | | | |
| Euro | | | | | |
| 1.350.000 | Ivory Coast Government International Bond* | 6,88 % | 17.10.2040 | 1.252.226 | 0,32 |
| 904.000 | Republic of Cameroon International Bond* | 5,95 % | 07.07.2032 | 739.865 | 0,19 |
| Euro insgesamt | | | | 1.992.091 | 0,51 |
| US-Dollar | | | | | |
| 1.250.000 | Angolan Government International Bond* | 8,25 % | 09.05.2028 | 1.155.419 | 0,30 |
| 1.002.000 | Angolan Government International Bond* | 8,75 % | 14.04.2032 | 883.986 | 0,23 |
| 250.000 | Brazilian Government International Bond** | 6,25 % | 18.03.2031 | 259.775 | 0,07 |
| 401.000 | Chile Government International Bond* | 4,95 % | 05.01.2036 | 397.261 | 0,10 |
| 436.000 | Dominican Republic International Bond* | 5,30 % | 21.01.2041 | 378.230 | 0,10 |
| 800.000 | Dominican Republic International Bond* | 6,85 % | 27.01.2045 | 800.000 | 0,20 |
| 928.000 | Egypt Government International Bond* | 7,50 % | 16.02.2061 | 544.908 | 0,14 |
| 600.000 | Egypt Government International Bond* | 7,63 % | 29.05.2032 | 418.583 | 0,11 |
| 1.000.000 | Ghana Government International Bond* | 10,75 % | 14.10.2030 | 633.126 | 0,16 |
| 367.000 | Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS* | 8,51 % | 14.01.2029 | 389.754 | 0,10 |
| 500.000 | Romanian Government International Bond* | 7,13 % | 17.01.2033 | 540.108 | 0,14 |
| 312.000 | Romanian Government International Bond* | 7,63 % | 17.01.2053 | 350.575 | 0,09 |
| 400.000 | Sri Lanka Government International Bond* | 5,88 % | 25.07.2024 | 211.800 | 0,05 |
| 349.000 | Türkiye Ihracat Kredi Bankasi AS* | 9,00 % | 28.01.2027 | 363.882 | 0,09 |
| 591.000 | Ukraine Government International Bond* | 6,88 % | 21.05.2031 | 137.821 | 0,03 |
| 1.000.000 | Ukraine Government International Bond* | 7,38 % | 25.09.2034 | 237.550 | 0,06 |

Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 3,94 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 459.000 | Ukraine Government International Bond* | 7,75 % | 01.09.2028 | 128.482 | 0,03 |
| 417.000 | Ukraine Government International Bond* | 7,75 % | 01.09.2029 | 115.637 | 0,03 |
| 1.000.000 | Ukraine Government International Bond* | 7,75 % | 01.08.2041 | 451.107 | 0,12 |
| 500.000 | Ukraine Government International Bond* | 9,75 % | 01.11.2030 | 145.000 | 0,04 |
| 5.080.000 | United States Treasury Note/Bond* | 3,88 % | 15.05.2043 | 4.844.653 | 1,24 |
| US-Dollar insgesamt | | | | 13.387.657 | 3,43 |
| Staatsanleihen insgesamt | | | | 15.379.748 | 3,94 |

| | | | | | |
|---|---|--------|------------|-------------------|-------------|
| Mittelfristige Schuldverschreibungen^ 3,87 % (31. Dezember 2022: 0,00 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 497.442 | AlixPartners LLP | 8,22 % | 04.02.2028 | 499.121 | 0,13 |
| 992.386 | Alterra Mountain Co | 8,97 % | 17.08.2028 | 995.075 | 0,25 |
| 995.000 | AppLovin Corp | 8,46 % | 19.08.2030 | 997.005 | 0,25 |
| 992.386 | APX Group Inc | 8,93 % | 10.07.2028 | 994.247 | 0,25 |
| 995.000 | Aramark Intermediate HoldCo Corp | 7,97 % | 22.06.2030 | 998.572 | 0,26 |
| 994.987 | Central Parent LLC | 9,35 % | 06.07.2029 | 1.001.773 | 0,26 |
| 1.406.318 | CQP Holdco LP | 8,35 % | 31.12.2030 | 1.411.275 | 0,36 |
| 1.000.000 | Flexera Software LLC | 0,00 % | 07.12.2028 | 1.000.705 | 0,26 |
| 498.649 | Great Outdoors Group LLC | 9,22 % | 06.03.2028 | 499.272 | 0,13 |
| 743.003 | Ingram Micro Inc | 8,61 % | 30.06.2028 | 746.253 | 0,19 |
| 992.424 | Medline Borrower LP | 8,47 % | 23.10.2028 | 998.548 | 0,26 |
| 997.494 | Select Medical Corp | 8,36 % | 06.03.2027 | 999.364 | 0,26 |
| 1.000.000 | Star Parent Inc | 9,35 % | 27.09.2030 | 990.695 | 0,25 |
| 991.552 | UFC Holdings LLC | 8,40 % | 29.04.2026 | 996.440 | 0,25 |
| 976.245 | William Morris Endeavor Entertainment LLC | 8,22 % | 18.05.2025 | 980.062 | 0,25 |
| 992.500 | World Wide Technology Holding Co LLC | 8,71 % | 01.03.2030 | 997.467 | 0,26 |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen insgesamt † | | | | 15.105.874 | 3,87 |

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|---|-----------------------------------|--------------------|------------------------------|
| Investmentfonds 0,01 % (31. Dezember 2022: 0,08 %) | | | |
| Britisches Pfund | | | |
| 75.108 | NB Global Monthly Income Fund Ltd | 66.832 | 0,01 |
| Investmentfonds insgesamt † | | 66.832 | 0,01 |
| Anlagen insgesamt | | 355.966.218 | 91,13 |

Devisenterminkontrakte 2,08 % (31. Dezember 2022: 7,36 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeits- datum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettover- mögens |
|-----------------------|------------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| 1.011.841 € | 1.075.997 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 42.429 | 0,01 |

Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 2,08 % (31. Dezember 2022: 7,36 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 5.732.223 € | 6.139.857 US\$ | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 2 | 196.184 | 0,05 |
| 1.051.738 € | 1.307.452 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 33.421 | 0,01 |
| 699.821 € | 873.782 US\$ | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 1 | 18.428 | 0,00 |
| 1.416.078 € | 1.738.678 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 66.697 | 0,02 |
| 1.190.276 US\$ | 1.074.358 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 2.748 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen CAD</i> | | | | | | |
| 1.041.907 CAD | 769.666 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 11 | 20.676 | 0,01 |
| 13.801.783 CAD | 10.169.497 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | 299.883 | 0,08 |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 174.959 € | 190.318 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 4 | 3.071 | 0,00 |
| 3.761.426 € | 4.005.083 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 3 | 152.563 | 0,04 |
| 4.097.812 € | 4.374.465 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 17 | 154.999 | 0,04 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 1.160.874 € | 1.466.911 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 13.101 | 0,00 |
| 76.382.127 € | 93.941.509 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 6 | 3.438.964 | 0,88 |
| 80.875.291 € | 99.421.599 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 9 | 3.687.263 | 0,94 |
| 177.169 US\$ | 138.657 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 4 | 393 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | 8.130.820 | 2,08 |

Futures-Kontrakte 0,96 % (31. Dezember 2022: 0,12 %)

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---|--------------------------------|----------------------|
| 39 | Euro-Bund Future March 2024 | 167.155 | 0,05 |
| 77 | US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2024 | 165.617 | 0,04 |
| 1.385 | US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2024 | 3.400.967 | 0,87 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten [±] | | 3.733.739 | 0,96 |

Total Return Swap-Kontrakte 0,07 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)

| Nominalwert | Datum der Schließung | Variabler Zinssatz | Referenzunternehmen | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|----------------------|--------------------|--|--------------------------------|----------------------|
| USD 15.998.663 | 20.03.2024 | 5,38 ¹ | iBoxx USD Liquid High Yield Index ² | 149.106 | 0,04 |
| USD 12.498.955 | 20.03.2024 | 5,38 ¹ | iBoxx USD Liquid High Yield Index ² | 119.157 | 0,03 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Total Return Swap-Kontrakten [∞] | | | | 268.263 | 0,07 |

¹ Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist die USD Secured Overnight Financing Rate.

² Die Gegenpartei für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist die JPMorgan Chase Bank.

| | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|--------------------|----------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 368.099.040 | 94,24 |

Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,89 %) (31. Dezember 2022: (2,75 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 737 US\$ | 1.000 CAD | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (22) | (0,00) |
| 14.464.690 US\$ | 11.784.003 £ | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 2 | (558.874) | (0,15) |
| 1.143.674 US\$ | 1.038.019 € | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 1 | (3.688) | (0,00) |
| 68.050.995 US\$ | 63.863.637 € | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 3 | (2.539.881) | (0,65) |
| <i>Abgesicherte Klassen CAD</i> | | | | | | |
| 57.101 US\$ | 78.076 CAD | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (2.124) | (0,00) |
| 69.046 US\$ | 94.467 CAD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (2.613) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 56.359 € | 62.514 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 4 | (218) | (0,00) |
| 96.257 US\$ | 90.816 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (4.125) | (0,00) |
| 3.538.985 US\$ | 3.212.904 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 16 | (12.360) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 912.716 £ | 1.167.469 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (3.836) | (0,00) |
| 2.198.466 US\$ | 1.808.803 £ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (107.599) | (0,03) |
| 6.158.583 US\$ | 4.997.131 £ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 19 | (212.318) | (0,06) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | (3.447.658) | (0,89) |

Futures-Kontrakte (1,32 %) (31. Dezember 2022: (0,13 %))

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|--|---------------------------------|----------------------|
| (474) | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2024 | (1.767.716) | (0,45) |
| (117) | US Treasury 10-Year Ultra Future March 2024 | (671.836) | (0,17) |
| (69) | US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2024 | (693.774) | (0,18) |
| (158) | US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2024 | (2.039.897) | (0,52) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten * | | (5.173.223) | (1,32) |

| | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|---|--------------------|----------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (8.620.881) | (2,21) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | 359.478.159 | 92,03 |
| Sonstiges Nettovermögen | 31.134.822 | 7,97 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | 390.612.981 | 100,00 |

^ Schuldverschreibungen mit einem Zinssatz von 0,00 %, wurden zum 31. Dezember 2023 eventuell noch nicht abgerechnet und haben somit keinen gültigen Zinssatz. Die Zinssätze werden erst bei Abrechnung gültig.

Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

| Portfolioanalyse | US\$ | % des Gesamtver- mögens |
|---|--------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 126.213.779 | 31,32 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 213.447.833 | 52,95 |
| † Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente | 16.237.774 | 4,03 |
| μ Investmentfonds | 66.832 | 0,02 |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | (1.439.484) | (0,36) |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente | 4.951.425 | 1,23 |
| Anlagen insgesamt | 359.478.159 | 89,19 |

Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 95,40 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) | | | | | |
| Euro | | | | | |
| 1.600.000 | Abertis Infraestructuras Finance BV [*] | 3,25 % | 29.12.2049 | 1.700.984 | 0,30 |
| 200.000 | Accor SA [*] | 7,25 % | 29.12.2049 | 240.914 | 0,04 |
| 228.962 | Adient Global Holdings Ltd [*] | 3,50 % | 15.08.2024 | 251.134 | 0,05 |
| 600.000 | Ahlstrom Holding 3 Oy [*] | 3,63 % | 04.02.2028 | 602.308 | 0,11 |
| 1.152.000 | Altice Financing SA ^{**} | 4,25 % | 15.08.2029 | 1.132.816 | 0,20 |
| 500.000 | Altice France Holding SA [*] | 8,00 % | 15.05.2027 | 318.447 | 0,06 |
| 200.000 | Altice France SA ^{**} | 2,13 % | 15.02.2025 | 213.654 | 0,04 |
| 250.000 | Altice France SA ^{**} | 4,13 % | 15.01.2029 | 221.497 | 0,04 |
| 983.000 | Altice France SA ^{**} | 4,25 % | 15.10.2029 | 868.111 | 0,16 |
| 186.000 | APA Infrastructure Ltd [*] | 7,13 % | 09.11.2083 | 216.275 | 0,04 |
| 868.000 | Aramark International Finance Sarl [*] | 3,13 % | 01.04.2025 | 956.709 | 0,17 |
| 1.049.000 | Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc [*] | 2,13 % | 15.08.2026 | 1.035.884 | 0,19 |
| 1.228.000 | Ashland Services BV ^{**} | 2,00 % | 30.01.2028 | 1.263.754 | 0,23 |
| 841.000 | Assemblin Group AB ^{**} | 8,96 % | 05.07.2029 | 945.055 | 0,17 |
| 250.000 | Avantor Funding Inc [*] | 3,88 % | 15.07.2028 | 271.259 | 0,05 |
| 1.072.000 | Avis Budget Finance Plc ^{**} | 7,25 % | 31.07.2030 | 1.271.275 | 0,23 |
| 654.000 | Azelis Finance NV [*] | 5,75 % | 15.03.2028 | 749.456 | 0,13 |
| 776.000 | Banijay Entertainment SASU ^{**} | 7,00 % | 01.05.2029 | 906.394 | 0,16 |
| 750.000 | Banijay Group SAS ^{**} | 6,50 % | 01.03.2026 | 829.659 | 0,15 |
| 525.000 | Benteler International AG [*] | 9,38 % | 15.05.2028 | 620.986 | 0,11 |
| 1.098.000 | Birkenstock Financing Sarl [*] | 5,25 % | 30.04.2029 | 1.209.678 | 0,22 |
| 439.000 | Boels Topholding BV ^{**} | 6,25 % | 15.02.2029 | 507.997 | 0,09 |
| 1.000.000 | Canpack SA/Canpack US LLC [*] | 2,38 % | 01.11.2027 | 1.015.406 | 0,18 |
| 580.000 | Castle UK Finco Plc ^{**} | 9,25 % | 15.05.2028 | 594.999 | 0,11 |
| 1.100.000 | CECONOMY AG [*] | 1,75 % | 24.06.2026 | 1.058.939 | 0,19 |
| 495.000 | Cerba Healthcare SACA [*] | 3,50 % | 31.05.2028 | 459.207 | 0,08 |
| 335.000 | Cerved Group SpA [*] | 6,00 % | 15.02.2029 | 338.790 | 0,06 |
| 1.210.000 | Cheplapharm Arzneimittel GmbH ^{**} | 7,50 % | 15.05.2030 | 1.427.400 | 0,26 |
| 1.891.000 | Constellium SE [*] | 3,13 % | 15.07.2029 | 1.927.264 | 0,34 |
| 1.075.000 | Coty Inc ^{**} | 3,88 % | 15.04.2026 | 1.187.835 | 0,21 |
| 640.000 | CPI Property Group SA [*] | 1,75 % | 14.01.2030 | 404.132 | 0,07 |
| 495.000 | Cullinan Holdco Scsp ^{**} | 4,63 % | 15.10.2026 | 427.435 | 0,08 |
| 901.000 | Dana Financing Luxembourg Sarl [*] | 8,50 % | 15.07.2031 | 1.091.832 | 0,19 |
| 700.000 | Deutsche Lufthansa AG [*] | 3,50 % | 14.07.2029 | 754.787 | 0,13 |
| 1.100.000 | Deutsche Lufthansa AG [*] | 3,75 % | 11.02.2028 | 1.201.533 | 0,22 |
| 500.000 | Dometic Group AB [*] | 3,00 % | 08.05.2026 | 545.169 | 0,10 |
| 1.065.000 | Douglas GmbH [*] | 6,00 % | 08.04.2026 | 1.165.784 | 0,21 |
| 575.000 | doValue SpA [*] | 3,38 % | 31.07.2026 | 574.183 | 0,10 |
| 543.000 | Dufry One BV [*] | 3,38 % | 15.04.2028 | 573.749 | 0,10 |

Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 95,40 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Euro (Fortsetzung) | | | | | |
| 475.000 | Elior Group SA* | 3,75 % | 15.07.2026 | 486.904 | 0,09 |
| 491.000 | Emerald Debt Merger Sub LLC** | 6,38 % | 15.12.2030 | 581.463 | 0,11 |
| 299.000 | Emeria SASU** | 3,38 % | 31.03.2028 | 284.483 | 0,05 |
| 1.083.000 | Enel SpA* | 6,38 % | 29.12.2049 | 1.253.679 | 0,23 |
| 1.030.000 | Energizer Gamma Acquisition BV** | 3,50 % | 30.06.2029 | 984.143 | 0,18 |
| 501.000 | Ephios Subco 3 Sarl** | 7,88 % | 31.01.2031 | 573.729 | 0,10 |
| 1.065.000 | Fiber Bidco SpA* | 9,89 % | 25.10.2027 | 1.198.628 | 0,22 |
| 250.000 | Fiber Bidco SpA* | 11,00 % | 25.10.2027 | 302.200 | 0,05 |
| 1.313.000 | Forvia SE* | 2,75 % | 15.02.2027 | 1.391.350 | 0,25 |
| 400.000 | Forvia SE* | 7,25 % | 15.06.2026 | 469.464 | 0,08 |
| 1.230.000 | Guala Closures SpA** | 7,93 % | 29.06.2029 | 1.380.603 | 0,25 |
| 1.020.000 | Heimstaden Bostad AB* | 3,25 % | 29.12.2049 | 591.984 | 0,11 |
| 740.000 | Iliad Holding SASU** | 5,13 % | 15.10.2026 | 816.909 | 0,15 |
| 2.030.000 | Iliad Holding SASU** | 5,63 % | 15.10.2028 | 2.256.813 | 0,40 |
| 1.051.000 | INEOS Quattro Finance 2 Plc* | 8,50 % | 15.03.2029 | 1.228.494 | 0,22 |
| 800.000 | Infineon Technologies AG* | 2,88 % | 29.12.2049 | 864.684 | 0,16 |
| 400.000 | Infineon Technologies AG* | 3,63 % | 29.12.2049 | 425.332 | 0,08 |
| 700.000 | International Consolidated Airlines Group SA* | 3,75 % | 25.03.2029 | 749.601 | 0,14 |
| 521.111 | Intrum AB* | 3,13 % | 15.07.2024 | 566.229 | 0,10 |
| 654.000 | IPD 3 BV* | 8,00 % | 15.06.2028 | 773.069 | 0,14 |
| 396.000 | IQVIA Inc** | 2,88 % | 15.06.2028 | 418.079 | 0,07 |
| 495.000 | Italmatch Chemicals SpA* | 10,00 % | 06.02.2028 | 566.544 | 0,10 |
| 400.000 | Jaguar Land Rover Automotive Plc* | 4,50 % | 15.07.2028 | 432.635 | 0,08 |
| 655.000 | Jaguar Land Rover Automotive Plc* | 6,88 % | 15.11.2026 | 774.758 | 0,14 |
| 405.000 | Kaixo Bondco Telecom SA* | 5,13 % | 30.09.2029 | 420.540 | 0,07 |
| 1.230.000 | Koninklijke KPN NV* | 6,00 % | 29.12.2049 | 1.411.177 | 0,25 |
| 2.978.000 | Lorca Telecom Bondco SA* | 4,00 % | 18.09.2027 | 3.218.721 | 0,58 |
| 200.000 | Loxam SAS* | 4,50 % | 15.04.2027 | 210.672 | 0,04 |
| 683.000 | Loxam SAS* | 5,75 % | 15.07.2027 | 744.743 | 0,13 |
| 712.000 | Loxam SAS* | 6,38 % | 15.05.2028 | 821.039 | 0,15 |
| 585.000 | Monitchem HoldCo 3 SA* | 8,75 % | 01.05.2028 | 661.840 | 0,12 |
| 720.000 | Motion Bondco DAC* | 4,50 % | 15.11.2027 | 724.534 | 0,13 |
| 604.000 | Motion Finco Sarl* | 7,38 % | 15.06.2030 | 683.677 | 0,12 |
| 1.627.000 | Multiversity SRL* | 8,20 % | 30.10.2028 | 1.808.499 | 0,32 |
| 374.000 | NH Hotel Group SA* | 4,00 % | 02.07.2026 | 409.747 | 0,07 |
| 2.134.000 | Novelis Sheet Ingot GmbH* | 3,38 % | 15.04.2029 | 2.230.715 | 0,40 |
| 1.122.000 | Olympus Water US Holding Corp* | 5,38 % | 01.10.2029 | 1.063.698 | 0,19 |
| 1.120.000 | Olympus Water US Holding Corp* | 9,63 % | 15.11.2028 | 1.329.924 | 0,24 |
| 224.000 | Paprec Holding SA** | 6,50 % | 17.11.2027 | 265.067 | 0,05 |

Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 95,40 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Euro (Fortsetzung) | | | | | |
| 513.000 | PCF GmbH* | 4,75 % | 15.04.2026 | 415.669 | 0,07 |
| 689.000 | Piaggio & C SpA* | 6,50 % | 05.10.2030 | 805.056 | 0,14 |
| 960.000 | PLT VII Finance Sarl** | 4,63 % | 05.01.2026 | 1.057.298 | 0,19 |
| 955.000 | Q-Park Holding I BV** | 1,50 % | 01.03.2025 | 1.035.895 | 0,19 |
| 800.000 | RCS & RDS SA* | 3,25 % | 05.02.2028 | 792.052 | 0,14 |
| 300.000 | SNF Group SACA* | 2,63 % | 01.02.2029 | 305.300 | 0,05 |
| 820.000 | Standard Industries Inc** | 2,25 % | 21.11.2026 | 858.951 | 0,15 |
| 229.768 | Summer BC Holdco A Sarl** | 9,25 % | 31.10.2027 | 227.740 | 0,04 |
| 905.000 | Summer BC Holdco B Sarl** | 5,75 % | 31.10.2026 | 960.019 | 0,17 |
| 880.000 | TDC Net A/S* | 5,06 % | 31.05.2028 | 1.011.438 | 0,18 |
| 800.949 | Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH** | 6,00 % | 30.07.2026 | 885.459 | 0,16 |
| 847.000 | Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH** | 2,00 % | 15.07.2025 | 917.419 | 0,16 |
| 1.811.000 | Telecom Italia SpA* | 2,88 % | 28.01.2026 | 1.940.440 | 0,35 |
| 300.000 | Telecom Italia SpA* | 6,88 % | 15.02.2028 | 353.761 | 0,07 |
| 1.102.000 | Telecom Italia SpA* | 7,88 % | 31.07.2028 | 1.355.381 | 0,24 |
| 1.400.000 | Telefonica Europe BV* | 4,38 % | 29.12.2049 | 1.538.128 | 0,28 |
| 200.000 | Telefonica Europe BV* | 6,14 % | 29.12.2049 | 227.712 | 0,04 |
| 1.500.000 | Telefonica Europe BV* | 7,13 % | 29.12.2049 | 1.792.971 | 0,32 |
| 325.000 | TI Automotive Finance Plc** | 3,75 % | 15.04.2029 | 330.148 | 0,06 |
| 1.697.000 | TK Elevator Midco GmbH** | 4,38 % | 15.07.2027 | 1.818.561 | 0,33 |
| 885.000 | Trivium Packaging Finance BV* | 3,75 % | 15.08.2026 | 949.047 | 0,17 |
| 740.000 | United Group BV** | 5,25 % | 01.02.2030 | 776.864 | 0,14 |
| 400.000 | Valeo SE* | 5,88 % | 12.04.2029 | 474.889 | 0,08 |
| 1.300.000 | Veolia Environnement SA* | 2,25 % | 29.12.2049 | 1.359.732 | 0,24 |
| 2.441.000 | Verisure Holding AB* | 3,88 % | 15.07.2026 | 2.652.886 | 0,47 |
| 400.000 | Verisure Midholding AB* | 5,25 % | 15.02.2029 | 422.995 | 0,08 |
| 200.000 | Virgin Media Finance Plc** | 3,75 % | 15.07.2030 | 203.512 | 0,04 |
| 700.000 | WMG Acquisition Corp* | 2,25 % | 15.08.2031 | 680.432 | 0,12 |
| 1.100.000 | ZF Europe Finance BV* | 3,00 % | 23.10.2029 | 1.121.703 | 0,20 |
| 800.000 | ZF Finance GmbH* | 3,75 % | 21.09.2028 | 854.732 | 0,15 |
| 1.660.000 | Ziggo Bond Co BV* | 3,38 % | 28.02.2030 | 1.553.407 | 0,28 |
| Euro insgesamt | | | | 96.138.657 | 17,23 |
| Britisches Pfund | | | | | |
| 741.000 | AA Bond Co Ltd* | 6,50 % | 31.01.2026 | 902.473 | 0,16 |
| 240.000 | AA Bond Co Ltd* | 7,38 % | 31.07.2029 | 306.874 | 0,05 |
| 735.000 | B&M European Value Retail SA* | 8,13 % | 15.11.2030 | 1.000.107 | 0,18 |
| 1.447.000 | Bellis Acquisition Co Plc** | 3,25 % | 16.02.2026 | 1.716.861 | 0,31 |
| 100.000 | Bellis Finco Plc** | 4,00 % | 16.02.2027 | 111.338 | 0,02 |
| 794.000 | British Telecommunications Plc* | 8,38 % | 20.12.2083 | 1.071.372 | 0,19 |

Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 95,40 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Britisches Pfund (Fortsetzung) | | | | | |
| 200.000 | Castle UK Finco Plc** | 7,00 % | 15.05.2029 | 217.285 | 0,04 |
| 800.000 | Co-operative Group Holdings 2011 Ltd* | 7,50 % | 08.07.2026 | 1.008.919 | 0,18 |
| 1.163.000 | CPUK Finance Ltd** | 6,50 % | 28.08.2026 | 1.437.892 | 0,26 |
| 213.000 | Iceland Bondco Plc** | 10,88 % | 15.12.2027 | 284.164 | 0,05 |
| 658.000 | Maison Finco Plc** | 6,00 % | 31.10.2027 | 728.083 | 0,13 |
| 1.374.000 | Mobico Group Plc* | 4,25 % | 29.12.2049 | 1.551.063 | 0,28 |
| 590.000 | Pinewood Finance Co Ltd** | 3,25 % | 30.09.2025 | 732.911 | 0,13 |
| 726.000 | Pinnacle Bidco Plc* | 10,00 % | 11.10.2028 | 964.265 | 0,17 |
| 790.000 | RAC Bond Co Plc** | 5,25 % | 04.11.2027 | 883.992 | 0,16 |
| 575.000 | Rolls-Royce Plc* | 5,75 % | 15.10.2027 | 737.591 | 0,13 |
| 300.000 | Travis Perkins Plc* | 3,75 % | 17.02.2026 | 361.788 | 0,06 |
| 416.000 | TVL Finance Plc** | 10,25 % | 28.04.2028 | 552.546 | 0,10 |
| 2.044.000 | Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC** | 4,88 % | 15.07.2028 | 2.404.829 | 0,43 |
| 610.000 | Zenith Finco Plc** | 6,50 % | 30.06.2027 | 634.704 | 0,11 |
| Britisches Pfund insgesamt | | | | 17.609.057 | 3,14 |
| US-Dollar | | | | | |
| 2.210.000 | 1011778 BC ULC/New Red Finance Inc** | 4,00 % | 15.10.2030 | 1.984.865 | 0,36 |
| 640.000 | 180 Medical Inc** | 3,88 % | 15.10.2029 | 577.168 | 0,11 |
| 1.020.000 | Acadia Healthcare Co Inc** | 5,50 % | 01.07.2028 | 1.005.744 | 0,18 |
| 692.000 | Access Bank Plc* | 6,13 % | 21.09.2026 | 624.634 | 0,11 |
| 280.000 | Acushnet Co** | 7,38 % | 15.10.2028 | 292.296 | 0,05 |
| 1.180.000 | Adani Green Energy Ltd* | 4,38 % | 08.09.2024 | 1.140.121 | 0,21 |
| 400.000 | Adani Green Energy UP Ltd/Prayatna Developers Pvt Ltd/Parampujya Solar Energ* | 6,25 % | 10.12.2024 | 395.759 | 0,07 |
| 40.000 | ADT Security Corp** | 4,13 % | 01.08.2029 | 36.854 | 0,01 |
| 1.795.000 | ADT Security Corp** | 4,88 % | 15.07.2032 | 1.662.341 | 0,30 |
| 810.000 | AerCap Global Aviation Trust* | 6,50 % | 15.06.2045 | 812.179 | 0,15 |
| 1.300.000 | Ahead DB Holdings LLC** | 6,63 % | 01.05.2028 | 1.133.931 | 0,20 |
| 1.000.000 | Akbank TAS** | 6,80 % | 06.02.2026 | 1.006.095 | 0,18 |
| 705.000 | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC** | 3,50 % | 15.03.2029 | 640.952 | 0,11 |
| 410.000 | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC** | 4,63 % | 15.01.2027 | 398.859 | 0,07 |
| 500.000 | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC** | 4,88 % | 15.02.2030 | 479.208 | 0,09 |
| 585.000 | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC** | 5,88 % | 15.02.2028 | 585.758 | 0,11 |
| 820.000 | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC** | 6,50 % | 15.02.2028 | 830.310 | 0,15 |
| 40.000 | Allegheny Technologies Inc* | 4,88 % | 01.10.2029 | 37.337 | 0,01 |
| 950.000 | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer** | 4,25 % | 15.10.2027 | 913.829 | 0,16 |
| 2.220.000 | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer** | 6,75 % | 15.10.2027 | 2.214.450 | 0,40 |
| 240.000 | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer** | 6,75 % | 15.04.2028 | 245.677 | 0,04 |
| 555.000 | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer** | 7,00 % | 15.01.2031 | 585.797 | 0,11 |
| 340.000 | Ally Financial Inc* | 5,80 % | 01.05.2025 | 340.589 | 0,06 |

Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 95,40 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 1.487.000 | Alsea SAB de CV** | 7,75 % | 14.12.2026 | 1.519.405 | 0,27 |
| 370.000 | Altice Financing SA** | 5,00 % | 15.01.2028 | 335.687 | 0,06 |
| 640.000 | Altice Financing SA** | 5,75 % | 15.08.2029 | 568.796 | 0,10 |
| 2.205.000 | Altice France SA* | 5,50 % | 15.01.2028 | 1.817.725 | 0,33 |
| 995.000 | Altice France SA** | 5,50 % | 15.10.2029 | 781.457 | 0,14 |
| 535.000 | American Airlines Inc** | 7,25 % | 15.02.2028 | 541.605 | 0,10 |
| 1.987.500 | American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd** | 5,50 % | 20.04.2026 | 1.974.624 | 0,35 |
| 2.520.000 | American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd** | 5,75 % | 20.04.2029 | 2.459.287 | 0,44 |
| 420.000 | Amkor Technology Inc** | 6,63 % | 15.09.2027 | 425.617 | 0,08 |
| 970.000 | Amsted Industries Inc** | 5,63 % | 01.07.2027 | 967.491 | 0,17 |
| 165.000 | AmWINS Group Inc** | 4,88 % | 30.06.2029 | 150.682 | 0,03 |
| 1.240.000 | AmWINS Group Inc 144A** | 4,88 % | 30.06.2029 | 1.134.053 | 0,20 |
| 1.165.000 | Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp** | 5,38 % | 15.06.2029 | 1.121.375 | 0,20 |
| 930.000 | Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp** | 5,75 % | 01.03.2027 | 923.361 | 0,17 |
| 2.475.000 | APX Group Inc** | 5,75 % | 15.07.2029 | 2.310.508 | 0,41 |
| 35.000 | APX Group Inc** | 6,75 % | 15.02.2027 | 34.962 | 0,01 |
| 690.000 | Aramark Services Inc** | 5,00 % | 01.02.2028 | 669.790 | 0,12 |
| 825.000 | Archrock Partners LP/Archrock Partners Finance Corp** | 6,88 % | 01.04.2027 | 827.879 | 0,15 |
| 1.125.000 | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc** | 4,00 % | 01.09.2029 | 953.703 | 0,17 |
| 255.000 | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc** | 6,00 % | 15.06.2027 | 254.246 | 0,05 |
| 935.000 | Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc** | 5,25 % | 15.08.2027 | 727.467 | 0,13 |
| 760.000 | Arsenal AIC Parent LLC** | 8,00 % | 01.10.2030 | 793.904 | 0,14 |
| 445.000 | Asbury Automotive Group Inc** | 4,63 % | 15.11.2029 | 412.391 | 0,07 |
| 3.970.000 | Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp** | 5,88 % | 30.06.2029 | 3.697.770 | 0,66 |
| 395.000 | Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp** | 7,00 % | 01.11.2026 | 398.098 | 0,07 |
| 2.735.000 | ASGN Inc** | 4,63 % | 15.05.2028 | 2.599.965 | 0,47 |
| 985.000 | Ashland Inc** | 3,38 % | 01.09.2031 | 850.767 | 0,15 |
| 1.770.000 | AssuredPartners Inc** | 5,63 % | 15.01.2029 | 1.654.345 | 0,29 |
| 3.585.000 | AthenaHealth Group Inc** | 6,50 % | 15.02.2030 | 3.257.017 | 0,58 |
| 35.000 | ATI Inc* | 5,88 % | 01.12.2027 | 34.533 | 0,01 |
| 1.525.000 | ATI Inc* | 7,25 % | 15.08.2030 | 1.588.473 | 0,28 |
| 480.000 | ATS Corp** | 4,13 % | 15.12.2028 | 441.807 | 0,08 |
| 960.000 | Avantor Funding Inc** | 4,63 % | 15.07.2028 | 928.523 | 0,16 |
| 1.950.000 | Avient Corp** | 7,13 % | 01.08.2030 | 2.029.753 | 0,36 |
| 685.000 | Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance Inc** | 8,00 % | 15.02.2031 | 684.647 | 0,12 |
| 570.000 | Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV** | 7,25 % | 15.02.2031 | 598.490 | 0,11 |
| 400.000 | Axis Bank Ltd* | 4,10 % | 29.12.2049 | 365.433 | 0,06 |
| 175.000 | Azul Secured Finance LLP** | 10,88 % | 28.05.2030 | 144.827 | 0,03 |
| 1.216.000 | Banco Davivienda SA** | 6,65 % | 29.12.2049 | 870.960 | 0,16 |
| 1.800.000 | Banco Mercantil del Norte SA* | 7,50 % | 29.12.2049 | 1.700.479 | 0,30 |

Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 95,40 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 616.000 | Bancolumbia SA [*] | 4,63 % | 18.12.2029 | 571.485 | 0,10 |
| 910.000 | Banjay Entertainment SASU ^{**} | 8,13 % | 01.05.2029 | 937.769 | 0,17 |
| 1.170.000 | Bath & Body Works Inc ^{**} | 6,63 % | 01.10.2030 | 1.196.550 | 0,21 |
| 480.000 | Bath & Body Works Inc [*] | 6,75 % | 01.07.2036 | 483.692 | 0,09 |
| 455.000 | Bausch Health Cos Inc ^{**} | 5,50 % | 01.11.2025 | 416.641 | 0,07 |
| 160.000 | Bausch Health Cos Inc ^{**} | 5,75 % | 15.08.2027 | 103.379 | 0,02 |
| 305.000 | Bausch Health Cos Inc ^{**} | 6,13 % | 01.02.2027 | 206.198 | 0,04 |
| 260.000 | Bausch Health Cos Inc ^{**} | 9,00 % | 15.12.2025 | 243.225 | 0,04 |
| 1.843.000 | BBVA Bancomer SA ^{**} | 5,88 % | 13.09.2034 | 1.738.875 | 0,31 |
| 1.910.000 | BCPE Empire Holdings Inc ^{**} | 7,63 % | 01.05.2027 | 1.843.725 | 0,33 |
| 390.000 | Beacon Roofing Supply Inc ^{**} | 4,13 % | 15.05.2029 | 355.952 | 0,06 |
| 575.000 | Beacon Roofing Supply Inc ^{**} | 4,50 % | 15.11.2026 | 560.733 | 0,10 |
| 765.000 | Beacon Roofing Supply Inc ^{**} | 6,50 % | 01.08.2030 | 782.776 | 0,14 |
| 1.225.000 | Benteler International AG ^{**} | 10,50 % | 15.05.2028 | 1.291.426 | 0,23 |
| 500.000 | Berry Global Inc ^{**} | 4,50 % | 15.02.2026 | 487.657 | 0,09 |
| 865.000 | Berry Global Inc ^{**} | 5,63 % | 15.07.2027 | 859.417 | 0,15 |
| 616.000 | Bidvest Group UK Plc [*] | 3,63 % | 23.09.2026 | 572.880 | 0,10 |
| 430.000 | Blackstone Mortgage Trust Inc ^{**} | 3,75 % | 15.01.2027 | 382.841 | 0,07 |
| 1.090.000 | Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp ^{**} | 6,63 % | 15.07.2026 | 1.084.436 | 0,19 |
| 200.000 | Borr IHC Ltd/Borr Finance LLC ^{**} | 10,00 % | 15.11.2028 | 209.000 | 0,04 |
| 1.325.000 | BroadStreet Partners Inc ^{**} | 5,88 % | 15.04.2029 | 1.237.926 | 0,22 |
| 65.000 | Buckeye Partners LP ^{**} | 4,13 % | 01.03.2025 | 63.460 | 0,01 |
| 750.000 | Buckeye Partners LP 144A ^{**} | 4,13 % | 01.03.2025 | 727.993 | 0,13 |
| 620.000 | Buckeye Partners LP ^{**} | 4,50 % | 01.03.2028 | 584.687 | 0,10 |
| 450.000 | Buckeye Partners LP ^{**} | 5,85 % | 15.11.2043 | 365.247 | 0,06 |
| 40.000 | Builders FirstSource Inc ^{**} | 5,00 % | 01.03.2030 | 38.669 | 0,01 |
| 505.000 | Builders FirstSource Inc ^{**} | 6,38 % | 15.06.2032 | 516.229 | 0,09 |
| 1.015.000 | Cable One Inc ^{**} | 4,00 % | 15.11.2030 | 823.046 | 0,15 |
| 1.095.000 | Calderys Financing LLC ^{**} | 11,25 % | 01.06.2028 | 1.148.261 | 0,21 |
| 850.000 | Calpine Corp ^{**} | 4,63 % | 01.02.2029 | 790.327 | 0,14 |
| 1.760.000 | Camelot Return Merger Sub Inc ^{**} | 8,75 % | 01.08.2028 | 1.788.730 | 0,32 |
| 1.128.000 | Canacol Energy Ltd ^{**} | 5,75 % | 24.11.2028 | 823.707 | 0,15 |
| 1.255.000 | Carpenter Technology Corp [*] | 6,38 % | 15.07.2028 | 1.251.759 | 0,22 |
| 35.000 | Carpenter Technology Corp [*] | 7,63 % | 15.03.2030 | 36.140 | 0,01 |
| 500.000 | CAS Capital No 1 Ltd [*] | 4,00 % | 29.12.2049 | 432.300 | 0,08 |
| 970.000 | Catalent Pharma Solutions Inc ^{**} | 3,13 % | 15.02.2029 | 849.963 | 0,15 |
| 250.000 | Catalent Pharma Solutions Inc ^{**} | 3,50 % | 01.04.2030 | 217.757 | 0,04 |
| 835.000 | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp ^{**} | 4,50 % | 01.06.2033 | 707.610 | 0,13 |
| 405.000 | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp ^{**} | 4,75 % | 01.02.2032 | 357.656 | 0,06 |
| 40.000 | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp ^{**} | 5,00 % | 01.02.2028 | 38.302 | 0,01 |

Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 95,40 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 1.565.000 | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp** | 5,13 % | 01.05.2027 | 1.513.034 | 0,27 |
| 190.000 | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp** | 5,50 % | 01.05.2026 | 188.853 | 0,03 |
| 2.175.000 | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp** | 6,38 % | 01.09.2029 | 2.147.797 | 0,39 |
| 1.015.000 | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp** | 7,38 % | 01.03.2031 | 1.042.394 | 0,19 |
| 430.000 | Cedar Fair LP** | 5,25 % | 15.07.2029 | 406.161 | 0,07 |
| 1.345.000 | Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op** | 6,50 % | 01.10.2028 | 1.336.819 | 0,24 |
| 614.000 | Cemex SAB de CV** | 5,13 % | 29.12.2049 | 582.798 | 0,10 |
| 945.000 | Cemex SAB de CV** | 9,13 % | 29.12.2049 | 1.007.502 | 0,18 |
| 1.700.000 | Central American Bottling Corp/CBC Bottling Holdco SL/Beliv Holdco SL** | 5,25 % | 27.04.2029 | 1.600.227 | 0,29 |
| 185.000 | Central Parent Inc/CDK Global Inc** | 7,25 % | 15.06.2029 | 188.810 | 0,03 |
| 150.000 | Central Parent LLC/CDK Global II LLC/CDK Financing Co Inc** | 8,00 % | 15.06.2029 | 156.680 | 0,03 |
| 1.860.000 | Chart Industries Inc** | 7,50 % | 01.01.2030 | 1.946.485 | 0,35 |
| 200.000 | Chart Industries Inc** | 9,50 % | 01.01.2031 | 217.400 | 0,04 |
| 45.000 | CHS/Community Health Systems Inc** | 5,25 % | 15.05.2030 | 37.698 | 0,01 |
| 180.000 | CHS/Community Health Systems Inc** | 5,63 % | 15.03.2027 | 167.480 | 0,03 |
| 255.000 | CHS/Community Health Systems Inc** | 6,00 % | 15.01.2029 | 229.824 | 0,04 |
| 500.000 | Ciena Corp** | 4,00 % | 31.01.2030 | 455.928 | 0,08 |
| 820.000 | Civitas Resources Inc** | 8,38 % | 01.07.2028 | 857.060 | 0,15 |
| 3.200.000 | Civitas Resources Inc** | 8,63 % | 01.11.2030 | 3.397.014 | 0,61 |
| 220.000 | Clearway Energy Operating LLC** | 3,75 % | 15.01.2032 | 191.918 | 0,04 |
| 1.735.000 | Clearway Energy Operating LLC** | 4,75 % | 15.03.2028 | 1.672.859 | 0,30 |
| 1.290.000 | CommScope Inc** | 4,75 % | 01.09.2029 | 867.326 | 0,15 |
| 1.135.000 | CommScope Inc** | 7,13 % | 01.07.2028 | 540.243 | 0,10 |
| 500.000 | Compania de Minas Buenaventura SAA** | 5,50 % | 23.07.2026 | 477.771 | 0,09 |
| 2.030.000 | Comstock Resources Inc** | 5,88 % | 15.01.2030 | 1.763.350 | 0,32 |
| 1.656.000 | Comstock Resources Inc** | 6,75 % | 01.03.2029 | 1.516.519 | 0,27 |
| 435.000 | Consensus Cloud Solutions Inc** | 6,50 % | 15.10.2028 | 395.017 | 0,07 |
| 1.700.000 | Constellium SE** | 5,63 % | 15.06.2028 | 1.661.050 | 0,30 |
| 549.010 | Continuum Energy Levanter Pte Ltd** | 4,50 % | 09.02.2027 | 516.683 | 0,09 |
| 725.000 | Cornerstone Building Brands Inc** | 6,13 % | 15.01.2029 | 595.243 | 0,11 |
| 590.000 | Coty Inc** | 5,00 % | 15.04.2026 | 581.048 | 0,10 |
| 285.000 | Coty Inc** | 6,50 % | 15.04.2026 | 284.867 | 0,05 |
| 435.000 | Coty Inc/HFC Prestige Products Inc/HFC Prestige International US LLC** | 6,63 % | 15.07.2030 | 447.152 | 0,08 |
| 2.770.000 | CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC** | 5,50 % | 15.06.2031 | 2.628.756 | 0,47 |
| 925.000 | CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC** | 7,50 % | 15.12.2033 | 959.722 | 0,17 |
| 1.240.000 | CSC Holdings LLC** | 4,50 % | 15.11.2031 | 939.053 | 0,17 |
| 540.000 | CSC Holdings LLC** | 5,25 % | 01.06.2024 | 529.006 | 0,10 |
| 1.455.000 | CSC Holdings LLC** | 5,38 % | 01.02.2028 | 1.286.618 | 0,23 |
| 1.115.000 | CSC Holdings LLC** | 5,50 % | 15.04.2027 | 1.031.338 | 0,19 |
| 105.000 | CSC Holdings LLC** | 5,75 % | 15.01.2030 | 65.472 | 0,01 |

Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 95,40 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 3.000.000 | CSC Holdings LLC 144A** | 5,75 % | 15.01.2030 | 1.870.620 | 0,34 |
| 535.000 | CSC Holdings LLC** | 11,25 % | 15.05.2028 | 551.620 | 0,10 |
| 730.000 | CSN Resources SA** | 4,63 % | 10.06.2031 | 597.945 | 0,11 |
| 220.000 | CSN Resources SA** | 8,88 % | 05.12.2030 | 229.464 | 0,04 |
| 800.000 | Cushman & Wakefield US Borrower LLC** | 6,75 % | 15.05.2028 | 796.812 | 0,14 |
| 1.285.000 | Cushman & Wakefield US Borrower LLC** | 8,88 % | 01.09.2031 | 1.362.775 | 0,25 |
| 1.575.000 | Dana Inc* | 4,50 % | 15.02.2032 | 1.372.131 | 0,25 |
| 820.000 | Dana Inc* | 5,38 % | 15.11.2027 | 815.080 | 0,15 |
| 115.000 | Dana Inc* | 5,63 % | 15.06.2028 | 113.485 | 0,02 |
| 540.000 | DaVita Inc** | 3,75 % | 15.02.2031 | 444.355 | 0,08 |
| 335.000 | DaVita Inc** | 4,63 % | 01.06.2030 | 292.748 | 0,05 |
| 925.000 | Dealer Tire LLC/DT Issuer LLC** | 8,00 % | 01.02.2028 | 916.828 | 0,16 |
| 500.000 | Ecopetrol SA** | 5,88 % | 28.05.2045 | 395.463 | 0,07 |
| 1.093.000 | Ecopetrol SA** | 6,88 % | 29.04.2030 | 1.084.460 | 0,19 |
| 709.000 | Ecopetrol SA* | 8,88 % | 13.01.2033 | 771.148 | 0,14 |
| 1.065.000 | Element Solutions Inc** | 3,88 % | 01.09.2028 | 981.522 | 0,17 |
| 430.000 | Embraer Netherlands Finance BV** | 7,00 % | 28.07.2030 | 451.498 | 0,08 |
| 835.000 | Emerald Debt Merger Sub LLC** | 6,63 % | 15.12.2030 | 853.887 | 0,15 |
| 650.000 | Emirates NBD Bank PJSC* | 6,13 % | 29.12.2049 | 647.185 | 0,12 |
| 1.335.000 | Encompass Health Corp* | 4,50 % | 01.02.2028 | 1.278.528 | 0,23 |
| 205.000 | Encompass Health Corp* | 4,63 % | 01.04.2031 | 188.880 | 0,03 |
| 990.000 | Endeavor Energy Resources LP/EER Finance Inc** | 5,75 % | 30.01.2028 | 991.553 | 0,18 |
| 300.000 | Endeavour Mining Plc** | 5,00 % | 14.10.2026 | 278.064 | 0,05 |
| 400.000 | Energian Israel Finance Ltd** | 5,38 % | 30.03.2028 | 352.517 | 0,06 |
| 2.645.000 | Energizer Holdings Inc** | 6,50 % | 31.12.2027 | 2.647.727 | 0,47 |
| 1.000.000 | EnerSys** | 4,38 % | 15.12.2027 | 950.625 | 0,17 |
| 770.000 | EnLink Midstream LLC** | 6,50 % | 01.09.2030 | 787.025 | 0,14 |
| 400.000 | ENN Clean Energy International Investment Ltd* | 3,38 % | 12.05.2026 | 375.357 | 0,07 |
| 1.320.000 | Enviri Corp** | 5,75 % | 31.07.2027 | 1.231.791 | 0,22 |
| 835.000 | EQM Midstream Partners LP** | 6,50 % | 01.07.2027 | 850.746 | 0,15 |
| 200.000 | EQM Midstream Partners LP** | 7,50 % | 01.06.2027 | 206.204 | 0,04 |
| 265.000 | EQM Midstream Partners LP** | 7,50 % | 01.06.2030 | 285.182 | 0,05 |
| 2.110.000 | EquipmentShare.com Inc** | 9,00 % | 15.05.2028 | 2.173.511 | 0,39 |
| 230.000 | First Quantum Minerals Ltd** | 6,88 % | 01.03.2026 | 206.182 | 0,04 |
| 800.000 | First Quantum Minerals Ltd** | 6,88 % | 15.10.2027 | 681.000 | 0,12 |
| 880.000 | First Quantum Minerals Ltd** | 7,50 % | 01.04.2025 | 839.877 | 0,15 |
| 315.000 | First Quantum Minerals Ltd** | 8,63 % | 01.06.2031 | 267.356 | 0,05 |
| 975.000 | FMG Resources August 2006 Pty Ltd** | 5,88 % | 15.04.2030 | 967.422 | 0,17 |
| 720.000 | Ford Motor Co* | 3,25 % | 12.02.2032 | 599.127 | 0,11 |
| 2.040.000 | Ford Motor Credit Co LLC* | 2,90 % | 10.02.2029 | 1.788.273 | 0,32 |

Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 95,40 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 890.000 | Ford Motor Credit Co LLC* | 4,13 % | 17.08.2027 | 843.323 | 0,15 |
| 580.000 | Ford Motor Credit Co LLC* | 6,80 % | 12.05.2028 | 606.203 | 0,11 |
| 215.000 | Ford Motor Credit Co LLC* | 7,35 % | 04.11.2027 | 226.875 | 0,04 |
| 490.000 | Ford Motor Credit Co LLC** | 8,37 % | 06.03.2026 | 503.367 | 0,09 |
| 570.000 | Fortrea Holdings Inc** | 7,50 % | 01.07.2030 | 586.087 | 0,11 |
| 400.000 | Franshion Brilliant Ltd* | 4,25 % | 23.07.2029 | 260.587 | 0,05 |
| 2.690.000 | Frontier Communications Holdings LLC** | 5,88 % | 15.10.2027 | 2.601.045 | 0,47 |
| 1.040.000 | Frontier Communications Holdings LLC** | 5,88 % | 01.11.2029 | 879.974 | 0,16 |
| 35.000 | Frontier Communications Holdings LLC** | 8,75 % | 15.05.2030 | 36.033 | 0,01 |
| 1.432.000 | FS Luxembourg Sarl** | 10,00 % | 15.12.2025 | 1.469.529 | 0,26 |
| 440.000 | Gap Inc** | 3,63 % | 01.10.2029 | 376.739 | 0,07 |
| 455.000 | Gen Digital Inc** | 6,75 % | 30.09.2027 | 463.169 | 0,08 |
| 685.000 | Gen Digital Inc** | 7,13 % | 30.09.2030 | 716.606 | 0,13 |
| 970.000 | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp* | 8,00 % | 15.01.2027 | 986.786 | 0,17 |
| 975.000 | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp* | 8,25 % | 15.01.2029 | 1.004.094 | 0,18 |
| 755.000 | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp* | 8,88 % | 15.04.2030 | 781.503 | 0,14 |
| 40.000 | GFL Environmental Inc** | 3,50 % | 01.09.2028 | 37.002 | 0,01 |
| 850.000 | GFL Environmental Inc** | 4,25 % | 01.06.2025 | 837.971 | 0,15 |
| 330.000 | Global Infrastructure Solutions Inc** | 5,63 % | 01.06.2029 | 301.752 | 0,05 |
| 815.000 | Global Infrastructure Solutions Inc** | 7,50 % | 15.04.2032 | 752.879 | 0,14 |
| 370.000 | Goodyear Tire & Rubber Co** | 4,88 % | 15.03.2027 | 358.487 | 0,06 |
| 230.000 | Goodyear Tire & Rubber Co** | 5,00 % | 31.05.2026 | 226.603 | 0,04 |
| 1.065.000 | Goodyear Tire & Rubber Co** | 5,00 % | 15.07.2029 | 1.007.560 | 0,18 |
| 1.440.000 | Goodyear Tire & Rubber Co** | 5,25 % | 15.07.2031 | 1.308.319 | 0,23 |
| 25.000 | Goodyear Tire & Rubber Co** | 9,50 % | 31.05.2025 | 25.384 | 0,01 |
| 370.000 | Greenko Dutch BV** | 3,85 % | 29.03.2026 | 345.367 | 0,06 |
| 903.600 | Greenko Power II Ltd* | 4,30 % | 13.12.2028 | 816.854 | 0,14 |
| 3.050.000 | GTCR AP Finance Inc** | 8,00 % | 15.05.2027 | 3.085.099 | 0,55 |
| 3.005.000 | GTCR W-2 Merger Sub LLC** | 7,50 % | 15.01.2031 | 3.177.404 | 0,57 |
| 1.600.000 | GYP Holdings III Corp** | 4,63 % | 01.05.2029 | 1.469.917 | 0,26 |
| 1.070.000 | Harvest Midstream I LP** | 7,50 % | 01.09.2028 | 1.064.832 | 0,19 |
| 1.090.000 | Hertz Corp** | 4,63 % | 01.12.2026 | 978.236 | 0,18 |
| 1.215.000 | Howard Midstream Energy Partners LLC** | 6,75 % | 15.01.2027 | 1.202.695 | 0,21 |
| 200.000 | Huarong Finance 2019 Co Ltd* | 4,50 % | 29.05.2029 | 177.370 | 0,03 |
| 200.000 | Huarong Finance II Co Ltd* | 5,50 % | 16.01.2025 | 198.250 | 0,03 |
| 950.000 | HUB International Ltd** | 5,63 % | 01.12.2029 | 907.475 | 0,16 |
| 1.415.000 | HUB International Ltd** | 7,00 % | 01.05.2026 | 1.422.110 | 0,25 |
| 1.460.000 | HUB International Ltd** | 7,25 % | 15.06.2030 | 1.543.081 | 0,28 |
| 960.000 | Hudbay Minerals Inc** | 4,50 % | 01.04.2026 | 930.861 | 0,17 |
| 1.265.000 | Hudbay Minerals Inc** | 6,13 % | 01.04.2029 | 1.241.995 | 0,22 |

Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 95,40 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 916.000 | IHS Netherlands Holdco BV** | 8,00 % | 18.09.2027 | 818.868 | 0,15 |
| 35.000 | Iliad Holding SASU** | 6,50 % | 15.10.2026 | 34.956 | 0,01 |
| 1.060.000 | Iliad Holding SASU** | 7,00 % | 15.10.2028 | 1.055.563 | 0,19 |
| 532.000 | Illuminate Buyer LLC/Illuminate Holdings IV Inc** | 9,00 % | 01.07.2028 | 509.337 | 0,09 |
| 1.220.000 | INEOS Finance Plc* | 6,75 % | 15.05.2028 | 1.199.537 | 0,21 |
| 605.000 | Iron Mountain Inc** | 4,88 % | 15.09.2029 | 573.645 | 0,11 |
| 770.000 | Iron Mountain Inc** | 5,63 % | 15.07.2032 | 730.742 | 0,13 |
| 400.000 | Itau Unibanco Holding SA* | 3,88 % | 15.04.2031 | 383.394 | 0,07 |
| 2.345.000 | ITT Holdings LLC** | 6,50 % | 01.08.2029 | 2.076.884 | 0,37 |
| 1.020.000 | Jaguar Land Rover Automotive Plc* | 5,50 % | 15.07.2029 | 995.225 | 0,18 |
| 720.000 | Jaguar Land Rover Automotive Plc* | 5,88 % | 15.01.2028 | 711.431 | 0,13 |
| 675.000 | Jaguar Land Rover Automotive Plc** | 7,75 % | 15.10.2025 | 683.129 | 0,12 |
| 2.405.000 | JELD-WEN Inc** | 4,88 % | 15.12.2027 | 2.275.250 | 0,41 |
| 524.000 | JSW Steel Ltd* | 5,05 % | 05.04.2032 | 452.494 | 0,08 |
| 670.000 | KB Home* | 4,80 % | 15.11.2029 | 641.297 | 0,12 |
| 410.000 | KB Home* | 6,88 % | 15.06.2027 | 426.682 | 0,08 |
| 1.205.000 | KB Home** | 7,25 % | 15.07.2030 | 1.248.818 | 0,22 |
| 985.000 | Kinetik Holdings LP** | 5,88 % | 15.06.2030 | 967.636 | 0,17 |
| 700.000 | Kosmos Energy Ltd* | 7,13 % | 04.04.2026 | 668.015 | 0,12 |
| 320.000 | Latam Airlines Group SA** | 13,38 % | 15.10.2027 | 358.022 | 0,06 |
| 99.000 | Latam Airlines Group SA** | 13,38 % | 15.10.2029 | 113.469 | 0,02 |
| 825.000 | Latam Airlines Group SA 144A** | 13,38 % | 15.10.2029 | 945.575 | 0,17 |
| 170.000 | Leeward Renewable Energy Operations LLC** | 4,25 % | 01.07.2029 | 148.308 | 0,03 |
| 1.715.000 | Leeward Renewable Energy Operations LLC 144A** | 4,25 % | 01.07.2029 | 1.495.996 | 0,27 |
| 2.010.000 | Legacy LifePoint Health LLC** | 4,38 % | 15.02.2027 | 1.857.881 | 0,33 |
| 1.170.000 | Level 3 Financing Inc** | 4,25 % | 01.07.2028 | 649.740 | 0,12 |
| 135.000 | Level 3 Financing Inc** | 4,63 % | 15.09.2027 | 81.590 | 0,01 |
| 670.000 | Level 3 Financing Inc 144A** | 4,63 % | 15.09.2027 | 404.929 | 0,07 |
| 940.000 | Level 3 Financing Inc** | 10,50 % | 15.05.2030 | 898.051 | 0,16 |
| 350.000 | Leviathan Bond Ltd* | 6,75 % | 30.06.2030 | 320.445 | 0,06 |
| 595.000 | LifePoint Health Inc** | 9,88 % | 15.08.2030 | 602.045 | 0,11 |
| 35.000 | Lindblad Expeditions Holdings Inc** | 9,00 % | 15.05.2028 | 36.346 | 0,01 |
| 770.000 | Lindblad Expeditions LLC** | 6,75 % | 15.02.2027 | 766.804 | 0,14 |
| 1.195.000 | Live Nation Entertainment Inc** | 3,75 % | 15.01.2028 | 1.117.436 | 0,20 |
| 70.000 | Live Nation Entertainment Inc** | 4,75 % | 15.10.2027 | 67.179 | 0,01 |
| 570.000 | Live Nation Entertainment Inc 144A** | 4,75 % | 15.10.2027 | 547.029 | 0,10 |
| 35.000 | Live Nation Entertainment Inc** | 6,50 % | 15.05.2027 | 35.635 | 0,01 |
| 485.000 | Macy's Retail Holdings LLC* | 4,50 % | 15.12.2034 | 393.692 | 0,07 |
| 145.000 | Macy's Retail Holdings LLC* | 5,13 % | 15.01.2042 | 113.307 | 0,02 |
| 360.000 | Macy's Retail Holdings LLC** | 5,88 % | 01.04.2029 | 346.004 | 0,06 |

Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 95,40 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 270.000 | Macy's Retail Holdings LLC** | 5,88 % | 15.03.2030 | 256.887 | 0,05 |
| 25.000 | Macy's Retail Holdings LLC** | 6,13 % | 15.03.2032 | 23.687 | 0,00 |
| 375.000 | Madison IAQ LLC** | 4,13 % | 30.06.2028 | 341.303 | 0,06 |
| 1.895.000 | Madison IAQ LLC** | 5,88 % | 30.06.2029 | 1.671.984 | 0,30 |
| 1.375.000 | Manitowoc Co Inc** | 9,00 % | 01.04.2026 | 1.385.215 | 0,25 |
| 800.000 | MARB BondCo Plc* | 3,95 % | 29.01.2031 | 650.480 | 0,11 |
| 1.070.000 | Masonite International Corp** | 3,50 % | 15.02.2030 | 928.787 | 0,17 |
| 1.855.000 | Masonite International Corp** | 5,38 % | 01.02.2028 | 1.783.323 | 0,32 |
| 515.000 | Mattamy Group Corp** | 4,63 % | 01.03.2030 | 477.827 | 0,08 |
| 195.000 | Mattamy Group Corp** | 5,25 % | 15.12.2027 | 189.808 | 0,03 |
| 850.000 | Mauser Packaging Solutions Holding Co** | 7,88 % | 15.08.2026 | 865.794 | 0,16 |
| 1.370.000 | Mauser Packaging Solutions Holding Co** | 9,25 % | 15.04.2027 | 1.346.217 | 0,24 |
| 1.623.338 | MC Brazil Downstream Trading Sarl** | 7,25 % | 30.06.2031 | 1.274.223 | 0,23 |
| 945.000 | McAfee Corp** | 7,38 % | 15.02.2030 | 864.284 | 0,15 |
| 750.000 | McGraw-Hill Education Inc** | 5,75 % | 01.08.2028 | 723.952 | 0,13 |
| 50.000 | McGraw-Hill Education Inc** | 8,00 % | 01.08.2029 | 46.548 | 0,01 |
| 765.000 | McGraw-Hill Education Inc 144A** | 8,00 % | 01.08.2029 | 712.184 | 0,13 |
| 800.000 | Medco Bell Pte Ltd** | 6,38 % | 30.01.2027 | 762.249 | 0,14 |
| 1.260.000 | Medline Borrower LP** | 3,88 % | 01.04.2029 | 1.140.746 | 0,20 |
| 2.630.000 | Medline Borrower LP** | 5,25 % | 01.10.2029 | 2.482.500 | 0,44 |
| 415.000 | Meritage Homes Corp* | 5,13 % | 06.06.2027 | 409.390 | 0,07 |
| 375.000 | Mersin Uluslararası Liman Isletmeciligi AS* | 8,25 % | 15.11.2028 | 392.051 | 0,07 |
| 570.000 | Midcontinent Communications/Midcontinent Finance Corp** | 5,38 % | 15.08.2027 | 556.089 | 0,10 |
| 1.386.900 | Millicom International Cellular SA* | 6,25 % | 25.03.2029 | 1.315.843 | 0,24 |
| 1.767.000 | Minerva Luxembourg SA* | 4,38 % | 18.03.2031 | 1.458.485 | 0,27 |
| 1.900.000 | Molina Healthcare Inc** | 4,38 % | 15.06.2028 | 1.798.833 | 0,32 |
| 960.000 | MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp* | 5,00 % | 15.10.2027 | 785.032 | 0,14 |
| 930.000 | MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp* | 5,25 % | 01.08.2026 | 832.427 | 0,15 |
| 745.000 | Mueller Water Products Inc** | 4,00 % | 15.06.2029 | 679.521 | 0,12 |
| 395.000 | Murphy Oil USA Inc* | 4,75 % | 15.09.2029 | 374.697 | 0,07 |
| 535.000 | Nabors Industries Inc** | 9,13 % | 31.01.2030 | 537.635 | 0,10 |
| 1.645.000 | Nabors Industries Ltd** | 7,25 % | 15.01.2026 | 1.582.852 | 0,28 |
| 40.000 | Nabors Industries Ltd** | 7,50 % | 15.01.2028 | 34.631 | 0,01 |
| 1.130.000 | NCL Corp Ltd** | 5,88 % | 15.02.2027 | 1.120.951 | 0,20 |
| 2.845.000 | NCL Corp Ltd** | 8,13 % | 15.01.2029 | 2.973.970 | 0,53 |
| 345.000 | NCL Finance Ltd** | 6,13 % | 15.03.2028 | 330.562 | 0,06 |
| 2.060.000 | Nemak SAB de CV** | 3,63 % | 28.06.2031 | 1.712.835 | 0,31 |
| 1.950.000 | Neptune Bidco US Inc** | 9,29 % | 15.04.2029 | 1.819.969 | 0,33 |
| 600.000 | Network i2i Ltd* | 5,65 % | 29.12.2049 | 594.258 | 0,11 |
| 1.615.000 | New Fortress Energy Inc** | 6,50 % | 30.09.2026 | 1.552.512 | 0,28 |

Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 95,40 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 1.315.000 | New Fortress Energy Inc** | 6,75 % | 15.09.2025 | 1.305.560 | 0,23 |
| 235.000 | NMG Holding Co Inc/Neiman Marcus Group LLC** | 7,13 % | 01.04.2026 | 226.012 | 0,04 |
| 1.165.000 | Northern Oil & Gas Inc** | 8,13 % | 01.03.2028 | 1.180.774 | 0,21 |
| 100.000 | Northern Oil & Gas Inc** | 8,75 % | 15.06.2031 | 104.285 | 0,02 |
| 600.000 | Northwest Fiber LLC/Northwest Fiber Finance Sub Inc** | 4,75 % | 30.04.2027 | 573.477 | 0,10 |
| 40.000 | Northwest Fiber LLC/Northwest Fiber Finance Sub Inc** | 6,00 % | 15.02.2028 | 37.021 | 0,01 |
| 380.000 | Northwest Fiber LLC/Northwest Fiber Finance Sub Inc** | 10,75 % | 01.06.2028 | 384.069 | 0,07 |
| 278.000 | NOVA Chemicals Corp** | 4,88 % | 01.06.2024 | 275.834 | 0,05 |
| 235.000 | NOVA Chemicals Corp** | 5,25 % | 01.06.2027 | 220.604 | 0,04 |
| 35.000 | NOVA Chemicals Corp** | 8,50 % | 15.11.2028 | 36.747 | 0,00 |
| 1.705.000 | Novelis Corp** | 4,75 % | 30.01.2030 | 1.606.201 | 0,29 |
| 350.000 | NuStar Logistics LP* | 6,00 % | 01.06.2026 | 349.697 | 0,06 |
| 455.000 | Olympus Water US Holding Corp** | 6,25 % | 01.10.2029 | 404.627 | 0,07 |
| 1.010.000 | Olympus Water US Holding Corp** | 7,13 % | 01.10.2027 | 1.011.914 | 0,18 |
| 795.000 | Olympus Water US Holding Corp** | 9,75 % | 15.11.2028 | 844.801 | 0,15 |
| 890.000 | OneMain Finance Corp* | 3,50 % | 15.01.2027 | 824.282 | 0,15 |
| 660.000 | OneMain Finance Corp* | 5,38 % | 15.11.2029 | 618.987 | 0,11 |
| 555.000 | OneMain Finance Corp* | 6,63 % | 15.01.2028 | 560.719 | 0,10 |
| 920.000 | OneMain Finance Corp** | 6,88 % | 15.03.2025 | 932.038 | 0,17 |
| 130.000 | OneMain Finance Corp** | 7,13 % | 15.03.2026 | 132.530 | 0,02 |
| 445.000 | OneMain Finance Corp* | 9,00 % | 15.01.2029 | 470.845 | 0,09 |
| 1.160.000 | Open Text Holdings Inc** | 4,13 % | 15.02.2030 | 1.051.122 | 0,19 |
| 1.767.000 | Oztel Holdings SPC Ltd* | 6,63 % | 24.04.2028 | 1.851.597 | 0,33 |
| 1.075.000 | Pactiv Evergreen Group Issuer Inc/Pactiv Evergreen Group Issuer LLC** | 4,00 % | 15.10.2027 | 1.005.797 | 0,18 |
| 540.000 | Pactiv Evergreen Group Issuer LLC/Pactiv Evergreen Group Issuer Inc** | 4,38 % | 15.10.2028 | 505.383 | 0,09 |
| 1.193.000 | Pampa Energia SA* | 7,50 % | 24.01.2027 | 1.165.747 | 0,21 |
| 1.565.000 | Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer** | 5,88 % | 01.10.2028 | 1.540.579 | 0,28 |
| 340.000 | Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer** | 7,50 % | 01.06.2025 | 342.138 | 0,06 |
| 1.335.000 | Performance Food Group Inc** | 4,25 % | 01.08.2029 | 1.225.814 | 0,22 |
| 290.000 | Performance Food Group Inc** | 5,50 % | 15.10.2027 | 286.057 | 0,05 |
| 400.000 | Periama Holdings LLC* | 5,95 % | 19.04.2026 | 395.096 | 0,07 |
| 40.000 | Permian Resources Operating LLC** | 5,88 % | 01.07.2029 | 39.051 | 0,01 |
| 1.740.000 | Permian Resources Operating LLC** | 7,00 % | 15.01.2032 | 1.796.407 | 0,32 |
| 1.429.000 | Petrobras Global Finance BV* | 6,50 % | 03.07.2033 | 1.452.210 | 0,26 |
| 40.000 | PetSmart Inc/PetSmart Finance Corp** | 4,75 % | 15.02.2028 | 37.741 | 0,01 |
| 1.390.000 | PetSmart Inc/PetSmart Finance Corp** | 7,75 % | 15.02.2029 | 1.353.371 | 0,24 |
| 2.655.000 | Presidio Holdings Inc** | 8,25 % | 01.02.2028 | 2.685.007 | 0,48 |
| 3.010.000 | Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc** | 5,75 % | 15.04.2026 | 3.028.204 | 0,54 |
| 2.295.000 | Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc** | 6,25 % | 15.01.2028 | 2.283.407 | 0,41 |
| 1.660.000 | Rackspace Technology Global Inc** | 3,50 % | 15.02.2028 | 668.324 | 0,12 |

Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 95,40 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 795.000 | Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp** | 5,25 % | 15.04.2030 | 594.368 | 0,11 |
| 925.000 | Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp** | 5,75 % | 15.01.2029 | 719.903 | 0,13 |
| 992.000 | Rede D'or Finance Sarl** | 4,50 % | 22.01.2030 | 900.001 | 0,16 |
| 365.000 | RegionalCare Hospital Partners Holdings Inc/LifePoint Health Inc** | 9,75 % | 01.12.2026 | 362.520 | 0,07 |
| 692.000 | ReNew Wind Energy AP2/ReNew Power Pvt Ltd other 9 Subsidiaries** | 4,50 % | 14.07.2028 | 615.608 | 0,11 |
| 1.500.000 | Resideo Funding Inc** | 4,00 % | 01.09.2029 | 1.310.700 | 0,23 |
| 605.000 | RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp** | 4,50 % | 15.02.2029 | 563.168 | 0,10 |
| 1.140.000 | RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp** | 4,75 % | 15.10.2027 | 1.101.953 | 0,20 |
| 835.000 | RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp** | 7,25 % | 15.07.2028 | 868.660 | 0,16 |
| 1.155.000 | Ritchie Bros Holdings Inc** | 6,75 % | 15.03.2028 | 1.190.600 | 0,21 |
| 1.035.000 | Ritchie Bros Holdings Inc** | 7,75 % | 15.03.2031 | 1.104.717 | 0,20 |
| 500.000 | RKPF Overseas 2020 A Ltd** | 5,20 % | 12.01.2026 | 130.370 | 0,02 |
| 565.000 | RLJ Lodging Trust LP** | 3,75 % | 01.07.2026 | 535.763 | 0,09 |
| 635.000 | RLJ Lodging Trust LP** | 4,00 % | 15.09.2029 | 571.280 | 0,10 |
| 165.000 | RLJ Lodging Trust LP 144A** | 4,00 % | 15.09.2029 | 148.443 | 0,03 |
| 575.000 | Rockcliff Energy II LLC** | 5,50 % | 15.10.2029 | 544.211 | 0,10 |
| 680.000 | Royal Caribbean Cruises Ltd** | 5,38 % | 15.07.2027 | 673.571 | 0,12 |
| 660.000 | Royal Caribbean Cruises Ltd** | 5,50 % | 31.08.2026 | 653.910 | 0,12 |
| 605.000 | Royal Caribbean Cruises Ltd** | 5,50 % | 01.04.2028 | 597.670 | 0,10 |
| 1.665.000 | Royal Caribbean Cruises Ltd** | 8,25 % | 15.01.2029 | 1.770.431 | 0,32 |
| 355.000 | Royal Caribbean Cruises Ltd* | 9,25 % | 15.01.2029 | 382.079 | 0,07 |
| 770.000 | Rumo Luxembourg Sarl** | 5,25 % | 10.01.2028 | 741.876 | 0,13 |
| 530.000 | Ryan Specialty LLC** | 4,38 % | 01.02.2030 | 492.237 | 0,09 |
| 550.000 | Samarco Mineracao SA** | 9,50 % | 30.06.2031 | 462.550 | 0,08 |
| 1.750.000 | Sasol Financing USA LLC* | 6,50 % | 27.09.2028 | 1.669.033 | 0,30 |
| 390.000 | Sasol Financing USA LLC* | 8,75 % | 03.05.2029 | 398.316 | 0,07 |
| 890.000 | SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC** | 5,38 % | 01.11.2026 | 855.394 | 0,15 |
| 1.135.000 | SeaWorld Parks & Entertainment Inc** | 5,25 % | 15.08.2029 | 1.062.344 | 0,19 |
| 830.000 | Select Medical Corp** | 6,25 % | 15.08.2026 | 834.685 | 0,15 |
| 1.030.000 | Sensata Technologies BV** | 4,00 % | 15.04.2029 | 958.338 | 0,17 |
| 785.000 | Sensata Technologies BV** | 5,88 % | 01.09.2030 | 780.746 | 0,14 |
| 1.349.000 | SEPLAT Energy Plc* | 7,75 % | 01.04.2026 | 1.243.778 | 0,22 |
| 500.000 | Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp** | 4,75 % | 15.02.2028 | 470.623 | 0,08 |
| 930.000 | Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp** | 4,75 % | 01.04.2029 | 860.473 | 0,15 |
| 211.000 | Shelf Drilling Holdings Ltd** | 9,63 % | 15.04.2029 | 206.634 | 0,04 |
| 740.000 | Shriram Finance Ltd* | 4,40 % | 13.03.2024 | 735.501 | 0,13 |
| 800.000 | SierraCol Energy Andina LLC** | 6,00 % | 15.06.2028 | 673.952 | 0,12 |
| 400.000 | Sirius XM Radio Inc** | 3,88 % | 01.09.2031 | 342.693 | 0,06 |
| 1.760.000 | Sirius XM Radio Inc** | 4,00 % | 15.07.2028 | 1.628.850 | 0,29 |
| 210.000 | Sirius XM Radio Inc** | 4,13 % | 01.07.2030 | 187.402 | 0,03 |

Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 95,40 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 1.005.000 | Sirius XM Radio Inc** | 5,50 % | 01.07.2029 | 972.755 | 0,17 |
| 800.000 | Sitio Royalties Operating Partnership LP/Sitio Finance Corp** | 7,88 % | 01.11.2028 | 829.648 | 0,15 |
| 410.000 | Six Flags Entertainment Corp** | 5,50 % | 15.04.2027 | 401.138 | 0,07 |
| 805.000 | Six Flags Entertainment Corp** | 7,25 % | 15.05.2031 | 808.003 | 0,14 |
| 910.000 | SNF Group SACA** | 3,13 % | 15.03.2027 | 828.865 | 0,15 |
| 45.000 | SNF Group SACA** | 3,38 % | 15.03.2030 | 38.711 | 0,01 |
| 2.885.000 | Solaris Midstream Holdings LLC** | 7,63 % | 01.04.2026 | 2.927.418 | 0,52 |
| 2.130.000 | SPX FLOW Inc** | 8,75 % | 01.04.2030 | 2.132.449 | 0,38 |
| 2.105.000 | SRS Distribution Inc** | 6,13 % | 01.07.2029 | 1.998.140 | 0,36 |
| 790.000 | Standard Industries Inc** | 3,38 % | 15.01.2031 | 680.791 | 0,12 |
| 285.000 | Standard Industries Inc** | 4,38 % | 15.07.2030 | 262.081 | 0,05 |
| 990.000 | Standard Industries Inc** | 5,00 % | 15.02.2027 | 965.945 | 0,17 |
| 745.000 | Star Parent Inc** | 9,00 % | 01.10.2030 | 786.052 | 0,14 |
| 460.000 | Starwood Property Trust Inc** | 4,38 % | 15.01.2027 | 434.003 | 0,08 |
| 660.000 | Summit Materials LLC/Summit Materials Finance Corp** | 7,25 % | 15.01.2031 | 695.857 | 0,12 |
| 2.030.000 | Summit Midstream Holdings LLC/Summit Midstream Finance Corp** | 9,00 % | 15.10.2026 | 2.015.962 | 0,36 |
| 1.025.000 | Sunnova Energy Corp** | 5,88 % | 01.09.2026 | 873.443 | 0,16 |
| 360.000 | Sunnova Energy Corp** | 11,75 % | 01.10.2028 | 327.929 | 0,06 |
| 185.000 | Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp** | 5,50 % | 15.01.2028 | 175.020 | 0,03 |
| 320.000 | Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp** | 6,00 % | 01.03.2027 | 313.245 | 0,06 |
| 1.875.000 | Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp** | 6,00 % | 31.12.2030 | 1.745.677 | 0,31 |
| 310.000 | Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp** | 6,00 % | 01.09.2031 | 287.173 | 0,05 |
| 620.000 | Taylor Morrison Communities Inc** | 5,13 % | 01.08.2030 | 600.454 | 0,11 |
| 205.000 | Taylor Morrison Communities Inc** | 5,88 % | 15.06.2027 | 206.260 | 0,04 |
| 910.000 | Taylor Morrison Communities Inc** | 6,63 % | 15.07.2027 | 897.342 | 0,16 |
| 1.140.000 | Team Health Holdings Inc [†] | 13,50 % | 30.06.2028 | 1.117.200 | 0,20 |
| 180.000 | TEGNA Inc** | 4,75 % | 15.03.2026 | 175.221 | 0,03 |
| 210.000 | Telecom Italia Capital SA** | 6,00 % | 30.09.2034 | 199.684 | 0,04 |
| 185.000 | Telecom Italia Capital SA** | 7,20 % | 18.07.2036 | 185.952 | 0,03 |
| 616.000 | Telecomunicaciones Digitales SA** | 4,50 % | 30.01.2030 | 531.547 | 0,10 |
| 360.000 | Tenet Healthcare Corp** | 4,25 % | 01.06.2029 | 335.552 | 0,06 |
| 600.000 | Tenet Healthcare Corp** | 4,88 % | 01.01.2026 | 593.662 | 0,11 |
| 1.670.000 | Tenet Healthcare Corp** | 6,13 % | 01.10.2028 | 1.666.744 | 0,30 |
| 35.000 | Tenet Healthcare Corp** | 6,13 % | 15.06.2030 | 35.432 | 0,01 |
| 985.000 | Tenet Healthcare Corp** | 6,25 % | 01.02.2027 | 990.522 | 0,18 |
| 1.725.000 | Tenet Healthcare Corp** | 6,75 % | 15.05.2031 | 1.765.193 | 0,32 |
| 1.515.000 | TerraForm Power Operating LLC** | 5,00 % | 31.01.2028 | 1.472.904 | 0,26 |
| 700.000 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV* | 4,10 % | 01.10.2046 | 474.805 | 0,09 |
| 600.000 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV* | 5,13 % | 09.05.2029 | 573.673 | 0,10 |
| 1.455.000 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV** | 7,88 % | 15.09.2029 | 1.569.961 | 0,28 |

Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 95,40 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 300.000 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV** | 8,13 % | 15.09.2031 | 327.549 | 0,06 |
| 375.000 | TK Elevator Holdco GmbH** | 7,63 % | 15.07.2028 | 368.809 | 0,06 |
| 895.000 | TK Elevator US Newco Inc** | 5,25 % | 15.07.2027 | 879.818 | 0,16 |
| 1.000.000 | TMS International Corp** | 6,25 % | 15.04.2029 | 826.355 | 0,15 |
| 500.000 | Total Play Telecomunicaciones SA de CV* | 6,38 % | 20.09.2028 | 203.765 | 0,04 |
| 1.180.000 | TransDigm Inc* | 4,63 % | 15.01.2029 | 1.108.610 | 0,20 |
| 795.000 | TransDigm Inc** | 6,25 % | 15.03.2026 | 794.433 | 0,14 |
| 1.385.000 | TransDigm Inc** | 6,75 % | 15.08.2028 | 1.418.700 | 0,25 |
| 2.430.000 | TransDigm Inc** | 6,88 % | 15.12.2030 | 2.504.492 | 0,45 |
| 580.000 | TransDigm Inc* | 7,50 % | 15.03.2027 | 583.301 | 0,11 |
| 775.000 | TreeHouse Foods Inc* | 4,00 % | 01.09.2028 | 686.998 | 0,12 |
| 40.000 | Tri Pointe Homes Inc* | 5,25 % | 01.06.2027 | 39.346 | 0,01 |
| 935.000 | Tri Pointe Homes Inc* | 5,70 % | 15.06.2028 | 926.122 | 0,17 |
| 965.000 | Trident TPI Holdings Inc** | 12,75 % | 31.12.2028 | 1.033.756 | 0,19 |
| 1.005.000 | Trivium Packaging Finance BV* | 5,50 % | 15.08.2026 | 987.065 | 0,18 |
| 1.390.000 | Trivium Packaging Finance BV* | 8,50 % | 15.08.2027 | 1.364.464 | 0,24 |
| 616.000 | Turk Telekomunikasyon AS* | 4,88 % | 19.06.2024 | 605.990 | 0,11 |
| 616.000 | Turkcell Iletisim Hizmetleri AS* | 5,80 % | 11.04.2028 | 585.791 | 0,10 |
| 327.000 | Turkiye Vakiflar Bankasi TAO* | 9,00 % | 12.10.2028 | 343.723 | 0,06 |
| 95.000 | United Airlines Inc** | 4,38 % | 15.04.2026 | 92.694 | 0,02 |
| 1.860.000 | United Airlines Inc 144A** | 4,38 % | 15.04.2026 | 1.813.854 | 0,32 |
| 1.865.000 | United Airlines Inc** | 4,63 % | 15.04.2029 | 1.746.163 | 0,31 |
| 690.000 | United Rentals North America Inc* | 3,75 % | 15.01.2032 | 611.289 | 0,11 |
| 40.000 | United Rentals North America Inc* | 4,00 % | 15.07.2030 | 36.888 | 0,01 |
| 380.000 | Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC** | 4,75 % | 15.04.2028 | 327.914 | 0,06 |
| 720.000 | US Foods Inc** | 4,75 % | 15.02.2029 | 684.363 | 0,12 |
| 565.000 | US Foods Inc** | 6,88 % | 15.09.2028 | 582.295 | 0,11 |
| 950.000 | US Foods Inc** | 7,25 % | 15.01.2032 | 991.764 | 0,18 |
| 455.000 | USI Inc** | 7,50 % | 15.01.2032 | 466.398 | 0,08 |
| 775.000 | Valaris Ltd** | 8,38 % | 30.04.2030 | 794.681 | 0,14 |
| 950.000 | Vedanta Resources Finance II Plc* | 8,95 % | 11.03.2025 | 707.313 | 0,13 |
| 550.000 | Vedanta Resources Finance II Plc* | 13,88 % | 21.01.2024 | 486.079 | 0,09 |
| 1.700.000 | Venture Global LNG Inc** | 8,13 % | 01.06.2028 | 1.718.372 | 0,31 |
| 1.210.000 | Venture Global LNG Inc** | 8,38 % | 01.06.2031 | 1.211.195 | 0,22 |
| 860.000 | Venture Global LNG Inc** | 9,50 % | 01.02.2029 | 910.561 | 0,16 |
| 550.000 | Venture Global LNG Inc** | 9,88 % | 01.02.2032 | 573.245 | 0,10 |
| 1.000.000 | Verde Purchaser LLC** | 10,50 % | 30.11.2030 | 1.008.900 | 0,18 |
| 1.240.000 | Vibrantz Technologies Inc** | 9,00 % | 15.02.2030 | 984.834 | 0,18 |
| 605.000 | Victoria's Secret & Co** | 4,63 % | 15.07.2029 | 506.125 | 0,09 |
| 1.310.000 | Virgin Media Secured Finance Plc* | 5,50 % | 15.05.2029 | 1.267.251 | 0,23 |

Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 95,40 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 1.665.000 | VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc** | 6,38 % | 01.02.2030 | 1.164.137 | 0,21 |
| 390.000 | VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc** | 7,88 % | 01.05.2027 | 335.890 | 0,06 |
| 335.000 | VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc** | 9,50 % | 01.06.2028 | 283.925 | 0,05 |
| 335.000 | Vistra Operations Co LLC** | 4,38 % | 01.05.2029 | 313.097 | 0,06 |
| 355.000 | Vistra Operations Co LLC** | 5,63 % | 15.02.2027 | 350.392 | 0,06 |
| 2.175.000 | Vistra Operations Co LLC** | 7,75 % | 15.10.2031 | 2.260.562 | 0,41 |
| 1.960.000 | VM Consolidated Inc** | 5,50 % | 15.04.2029 | 1.852.716 | 0,33 |
| 1.015.000 | Vmed O2 UK Financing I Plc** | 4,25 % | 31.01.2031 | 887.597 | 0,16 |
| 301.000 | VTR Finance NV** | 6,38 % | 15.07.2028 | 78.805 | 0,01 |
| 360.000 | WE Soda Investments Holding Plc** | 9,50 % | 06.10.2028 | 372.528 | 0,07 |
| 1.290.000 | White Cap Buyer LLC** | 6,88 % | 15.10.2028 | 1.250.348 | 0,22 |
| 1.530.000 | White Cap Parent LLC** | 8,25 % | 15.03.2026 | 1.524.894 | 0,27 |
| 835.000 | Williams Scotsman Inc** | 7,38 % | 01.10.2031 | 876.234 | 0,16 |
| 3.260.000 | Windsor Holdings III LLC** | 8,50 % | 15.06.2030 | 3.410.866 | 0,61 |
| 865.000 | WMG Acquisition Corp** | 3,75 % | 01.12.2029 | 788.599 | 0,14 |
| 355.000 | WR Grace Holdings LLC** | 5,63 % | 15.08.2029 | 312.793 | 0,06 |
| 1.920.000 | XHR LP** | 4,88 % | 01.06.2029 | 1.769.530 | 0,32 |
| 35.000 | XPO Inc** | 6,25 % | 01.06.2028 | 35.486 | 0,01 |
| 1.045.000 | XPO Inc** | 7,13 % | 01.06.2031 | 1.082.897 | 0,19 |
| 585.000 | XPO Inc** | 7,13 % | 01.02.2032 | 604.134 | 0,11 |
| 300.000 | Yanlord Land HK Co Ltd** | 5,13 % | 20.05.2026 | 174.837 | 0,03 |
| 800.000 | Yapi ve Kredi Bankasi AS* | 5,85 % | 21.06.2024 | 799.247 | 0,14 |
| 440.000 | Yapi ve Kredi Bankasi AS** | 9,25 % | 16.10.2028 | 467.194 | 0,09 |
| 500.000 | YPF SA* | 6,95 % | 21.07.2027 | 447.886 | 0,08 |
| 500.000 | YPF SA** | 7,00 % | 15.12.2047 | 378.228 | 0,07 |
| 500.000 | YPF SA* | 8,50 % | 27.06.2029 | 463.548 | 0,08 |
| 735.000 | Yum! Brands Inc* | 3,63 % | 15.03.2031 | 663.649 | 0,12 |
| 40.000 | Yum! Brands Inc** | 4,75 % | 15.01.2030 | 38.816 | 0,01 |
| 245.000 | Zayo Group Holdings Inc** | 4,00 % | 01.03.2027 | 196.685 | 0,04 |
| 355.000 | ZF North America Capital Inc** | 4,75 % | 29.04.2025 | 351.200 | 0,06 |
| 315.000 | ZF North America Capital Inc** | 6,88 % | 14.04.2028 | 326.622 | 0,06 |
| 535.000 | ZF North America Capital Inc** | 7,13 % | 14.04.2030 | 570.823 | 0,10 |
| 185.000 | Ziff Davis Inc** | 4,63 % | 15.10.2030 | 169.931 | 0,03 |
| 2.030.000 | Ziggo BV* | 4,88 % | 15.01.2030 | 1.813.167 | 0,32 |
| 790.000 | ZoomInfo Technologies LLC/ZoomInfo Finance Corp** | 3,88 % | 01.02.2029 | 717.020 | 0,13 |
| US-Dollar insgesamt | | | | 418.751.767 | 75,03 |
| Unternehmensanleihen insgesamt | | | | 532.499.481 | 95,40 |

Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|--------------------------------|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| Mittelfristige Schuldverschreibungen 0,00 % (31. Dezember 2022: 0,31 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 4.933 | Starwood Property Mortgage LLC | 8,71 % | 26.07.2026 | 4.933 | 0,00 |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen insgesamt [†] | | | | 4.933 | 0,00 |
| Anlagen insgesamt | | | | 532.504.414 | 95,40 |

Devisenterminkontrakte 2,14 % (31. Dezember 2022: 3,82 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeits- datum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Netto- vermögens |
|---|------------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------------|---------------------------|
| 898.378 € | 961.324 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 5 | 31.688 | 0,01 |
| 2.187.229 € | 2.341.696 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 4 | 75.930 | 0,01 |
| 21.182.960 € | 23.168.311 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 4 | 246.011 | 0,05 |
| 2.810.095 £ | 3.548.318 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | 34.305 | 0,01 |
| 1.671.139 £ | 2.049.004 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 4 | 81.549 | 0,01 |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> | | | | | | |
| 1.565 AUD | 1.031 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 5 | 37 | 0,00 |
| 205 AUD | 135 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | 5 | 0,00 |
| 39.326 AUD | 25.326 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 7 | 1.522 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> | | | | | | |
| 906.465 CHF | 1.045.005 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 33.762 | 0,01 |
| 3.569.614 CHF | 4.051.785 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 7 | 196.345 | 0,03 |
| 78.898.130 CHF | 88.202.593 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 23 | 5.692.568 | 1,03 |
| 32.259 US\$ | 26.940 CHF | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 199 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 1.030.137 € | 1.110.288 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | 28.361 | 0,00 |
| 58.382.707 € | 62.244.767 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 5 | 2.287.832 | 0,41 |
| 59.186.586 € | 63.087.794 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 27 | 2.333.363 | 0,41 |
| 45.569 US\$ | 41.008 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | 240 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 202.228 £ | 254.506 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | 3.317 | 0,00 |
| 18.206.977 £ | 22.367.379 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 4 | 844.911 | 0,16 |
| 1.183.989 £ | 1.465.810 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 35 | 43.672 | 0,00 |
| 61.710 US\$ | 48.358 £ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 4 | 57 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | 11.935.674 | 2,14 |

| | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|--|--------------------|---------------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 544.440.088 | 97,54 |

Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (1,21 %) (31. Dezember 2022: (2,80 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 90.430 € | 100.000 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (44) | (0,00) |
| 375.417 € | 327.029 £ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (1.970) | (0,00) |
| 935.858 € | 819.679 £ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (10.579) | (0,00) |
| 33.340 £ | 38.714 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (287) | (0,00) |
| 1.840.618 £ | 2.348.408 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (1.782) | (0,00) |
| 6.419.437 US\$ | 5.867.308 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | (65.918) | (0,02) |
| 72.692 US\$ | 57.866 £ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (1.082) | (0,00) |
| 114.576.074 US\$ | 107.621.530 € | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | (4.382.047) | (0,79) |
| 20.651.320 US\$ | 16.819.926 £ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (792.602) | (0,14) |
| 1.949.579 US\$ | 1.597.060 £ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (86.532) | (0,02) |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> | | | | | | |
| 245 AUD | 168 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (0) | (0,00) |
| 159 US\$ | 251 AUD | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (12) | (0,00) |
| 155 US\$ | 244 AUD | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (12) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> | | | | | | |
| 491.000 CHF | 584.944 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (614) | (0,00) |
| 543.078 US\$ | 483.199 CHF | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (31.968) | (0,01) |
| 529.683 US\$ | 467.994 CHF | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (27.268) | (0,00) |
| 3.497.645 US\$ | 3.087.196 CHF | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 82 | (176.371) | (0,02) |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 550.792 € | 610.270 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (1.459) | (0,00) |
| 46.251 € | 51.406 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | (283) | (0,00) |
| 1.196.381 US\$ | 1.128.477 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (50.966) | (0,02) |
| 11.940.473 US\$ | 11.203.653 € | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (443.346) | (0,08) |
| 18.395.227 US\$ | 17.196.600 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 83 | (612.825) | (0,10) |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 92.070 £ | 117.768 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (387) | (0,00) |
| 169 £ | 217 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | (0) | (0,00) |
| 284.770 US\$ | 234.277 £ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (13.913) | (0,00) |
| 1.448.163 US\$ | 1.164.105 £ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 56 | (35.967) | (0,01) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ^{oo} | | | | | (6.738.234) | (1,21) |

| | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|---|--------------------|------------------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (6.738.234) | (1,21) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | 537.701.854 | 96,33 |
| Sonstiges Nettovermögen | 20.462.051 | 3,67 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | 558.163.905 | 100,00 |

Global High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

| Portfolioanalyse | US\$ | % des Gesamtver- mögens |
|---|--------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 142.684.669 | 25,23 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 388.697.612 | 68,72 |
| † Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente | 1.122.133 | 0,20 |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente | 5.197.440 | 0,92 |
| Anlagen insgesamt | 537.701.854 | 95,07 |

Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 93,78 % (31. Dezember 2022: 94,02 %) | | | | | |
| Kanadischer Dollar | | | | | |
| 455.000 | Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada† | 2,50 % | 14.05.2030 | 308.382 | 0,36 |
| 195.000 | Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada† | 4,45 % | 27.02.2047 | 136.218 | 0,16 |
| 455.000 | Canadian Pacific Railway Co† | 2,54 % | 28.02.2028 | 323.484 | 0,37 |
| 455.000 | Enbridge Inc† | 4,24 % | 27.08.2042 | 301.745 | 0,35 |
| 410.000 | TELUS Corp† | 2,75 % | 08.07.2026 | 299.375 | 0,34 |
| 325.000 | TELUS Corp* | 4,40 % | 01.04.2043 | 221.589 | 0,26 |
| 620.000 | Thomson Reuters Corp† | 2,24 % | 14.05.2025 | 454.579 | 0,52 |
| Kanadischer Dollar insgesamt | | | | 2.045.372 | 2,36 |
| Euro | | | | | |
| 100.000 | ABN AMRO Bank NV* | 0,60 % | 15.01.2027 | 102.005 | 0,12 |
| 200.000 | ABN AMRO Bank NV* | 5,50 % | 21.09.2033 | 231.515 | 0,27 |
| 200.000 | Allianz SE* | 5,82 % | 25.07.2053 | 242.568 | 0,28 |
| 139.000 | American Tower Corp* | 0,88 % | 21.05.2029 | 134.061 | 0,15 |
| 150.000 | American Tower Corp* | 0,95 % | 05.10.2030 | 139.291 | 0,16 |
| 200.000 | American Tower Corp* | 4,13 % | 16.05.2027 | 225.846 | 0,26 |
| 250.000 | Anheuser-Busch InBev SA* | 2,75 % | 17.03.2036 | 264.224 | 0,30 |
| 200.000 | Arkema SA* | 4,25 % | 20.05.2030 | 231.094 | 0,27 |
| 200.000 | Aroundtown SA* | 1,00 % | 07.01.2025 | 210.939 | 0,24 |
| 400.000 | Aroundtown SA* | 1,45 % | 09.07.2028 | 345.680 | 0,40 |
| 300.000 | Aroundtown SA* | 1,63 % | 31.01.2028 | 269.533 | 0,31 |
| 300.000 | AT&T Inc* | 2,45 % | 15.03.2035 | 295.677 | 0,34 |
| 300.000 | AT&T Inc* | 4,30 % | 18.11.2034 | 350.946 | 0,40 |
| 300.000 | ATF Netherlands BV* | 7,08 % | 29.12.2049 | 145.907 | 0,17 |
| 190.000 | Athene Global Funding* | 0,83 % | 08.01.2027 | 193.779 | 0,22 |
| 157.000 | AusNet Services Holdings Pty Ltd† | 1,63 % | 11.03.2081 | 156.960 | 0,18 |
| 100.000 | Australia & New Zealand Banking Group Ltd† | 5,10 % | 03.02.2033 | 113.704 | 0,13 |
| 100.000 | Banco Santander SA* | 4,88 % | 18.10.2031 | 117.776 | 0,14 |
| 150.000 | Bank of America Corp* | 1,95 % | 27.10.2026 | 160.924 | 0,18 |
| 100.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA* | 3,88 % | 16.06.2032 | 109.299 | 0,13 |
| 100.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA* | 4,38 % | 02.05.2030 | 114.969 | 0,13 |
| 100.000 | Barclays Plc* | 4,92 % | 08.08.2030 | 115.183 | 0,13 |
| 500.000 | Bayerische Landesbank* | 7,00 % | 05.01.2034 | 573.149 | 0,66 |
| 100.000 | BP Capital Markets Plc† | 1,10 % | 15.11.2034 | 87.459 | 0,10 |
| 100.000 | BPCE SA* | 4,75 % | 14.06.2034 | 117.770 | 0,13 |
| 100.000 | BPCE SA* | 5,13 % | 25.01.2035 | 113.890 | 0,13 |
| 100.000 | BPCE SA* | 5,75 % | 01.06.2033 | 116.933 | 0,13 |
| 100.000 | BUPA Finance Plc* | 5,00 % | 12.10.2030 | 118.891 | 0,14 |
| 300.000 | Carmila SA* | 5,50 % | 09.10.2028 | 343.990 | 0,40 |
| 100.000 | Commerzbank AG* | 5,13 % | 18.01.2030 | 115.809 | 0,13 |

Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 93,78 % (31. Dezember 2022: 94,02 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Euro (Fortsetzung) | | | | | |
| 100.000 | Commerzbank AG [*] | 6,75 % | 05.10.2033 | 117.861 | 0,14 |
| 136.000 | Digital Dutch Finco BV [*] | 1,00 % | 15.01.2032 | 119.932 | 0,14 |
| 310.000 | Digital Dutch Finco BV [*] | 1,25 % | 01.02.2031 | 287.094 | 0,33 |
| 322.000 | Discovery Communications LLC [*] | 1,90 % | 19.03.2027 | 339.094 | 0,39 |
| 100.000 | Duke Energy Corp [*] | 3,85 % | 15.06.2034 | 109.537 | 0,13 |
| 100.000 | Electricite de France SA [*] | 4,75 % | 12.10.2034 | 119.410 | 0,14 |
| 100.000 | Enel SpA [*] | 6,63 % | 29.12.2049 | 117.799 | 0,14 |
| 200.000 | Fastighets AB Balder [*] | 1,88 % | 23.01.2026 | 201.802 | 0,23 |
| 269.000 | Global Payments Inc [*] | 4,88 % | 17.03.2031 | 312.709 | 0,36 |
| 120.000 | Heimstaden Bostad Treasury BV [*] | 0,63 % | 24.07.2025 | 117.831 | 0,14 |
| 400.000 | Heimstaden Bostad Treasury BV [*] | 1,00 % | 13.04.2028 | 318.237 | 0,37 |
| 117.000 | Heimstaden Bostad Treasury BV [*] | 1,38 % | 03.03.2027 | 102.753 | 0,12 |
| 740.000 | Heimstaden Bostad Treasury BV [*] | 1,38 % | 24.07.2028 | 589.046 | 0,68 |
| 410.000 | HSBC Holdings Plc [*] | 4,79 % | 10.03.2032 | 479.820 | 0,55 |
| 200.000 | Imerys SA [*] | 4,75 % | 29.11.2029 | 224.722 | 0,26 |
| 100.000 | ING Groep NV [*] | 4,75 % | 23.05.2034 | 117.770 | 0,14 |
| 150.000 | Intesa Sanpaolo SpA ^{**} | 5,63 % | 08.03.2033 | 178.659 | 0,21 |
| 400.000 | JPMorgan Chase & Co [*] | 4,46 % | 13.11.2031 | 466.164 | 0,54 |
| 100.000 | Linde Plc [*] | 3,63 % | 12.06.2034 | 115.899 | 0,13 |
| 200.000 | McDonald's Corp [*] | 4,13 % | 28.11.2035 | 233.469 | 0,27 |
| 95.000 | Metropolitan Life Global Funding I [*] | 4,00 % | 05.04.2028 | 108.369 | 0,12 |
| 165.000 | Morgan Stanley [*] | 5,15 % | 25.01.2034 | 200.719 | 0,23 |
| 73.000 | Nasdaq Inc [*] | 0,90 % | 30.07.2033 | 64.076 | 0,07 |
| 160.000 | National Grid North America Inc [*] | 4,67 % | 12.09.2033 | 188.934 | 0,22 |
| 186.000 | National Grid Plc [*] | 2,95 % | 30.03.2030 | 200.466 | 0,23 |
| 483.000 | Nationwide Building Society [*] | 2,00 % | 25.07.2029 | 523.616 | 0,60 |
| 130.000 | Nationwide Building Society [*] | 4,50 % | 01.11.2026 | 148.156 | 0,17 |
| 249.000 | NatWest Group Plc [*] | 0,67 % | 14.09.2029 | 239.407 | 0,28 |
| 121.000 | NatWest Group Plc [*] | 1,04 % | 14.09.2032 | 118.288 | 0,14 |
| 125.000 | Nordea Bank Abp [*] | 1,00 % | 27.06.2029 | 135.245 | 0,16 |
| 100.000 | Orsted AS [*] | 5,25 % | 29.12.2049 | 110.355 | 0,13 |
| 175.000 | Procter & Gamble Co [*] | 3,25 % | 02.08.2031 | 199.768 | 0,23 |
| 200.000 | Sandoz Finance BV [*] | 4,50 % | 17.11.2033 | 234.760 | 0,27 |
| 200.000 | Sogecap SA [*] | 6,50 % | 16.05.2044 | 238.995 | 0,27 |
| 831.000 | Southern Co [*] | 1,88 % | 15.09.2081 | 789.532 | 0,91 |
| 155.000 | Svenska Handelsbanken AB [*] | 5,00 % | 16.08.2034 | 179.842 | 0,21 |
| 500.000 | Thames Water Utilities Finance Plc [*] | 4,38 % | 18.01.2031 | 523.913 | 0,60 |
| 124.000 | TotalEnergies SE [*] | 1,63 % | 29.12.2049 | 122.878 | 0,14 |
| 200.000 | Traton Finance Luxembourg SA [*] | 4,50 % | 23.11.2026 | 225.751 | 0,26 |
| 600.000 | UBS Group AG [*] | 3,25 % | 02.04.2026 | 657.056 | 0,76 |

Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 93,78 % (31. Dezember 2022: 94,02 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Euro (Fortsetzung) | | | | | |
| 365.000 | UBS Group AG* | 4,38 % | 11.01.2031 | 416.890 | 0,48 |
| 200.000 | UBS Group AG* | 4,75 % | 17.03.2032 | 233.232 | 0,27 |
| 392.000 | Verizon Communications Inc* | 0,75 % | 22.03.2032 | 356.057 | 0,41 |
| 116.000 | Verizon Communications Inc* | 4,25 % | 31.10.2030 | 136.021 | 0,16 |
| 100.000 | Volkswagen Bank GmbH* | 4,63 % | 03.05.2031 | 116.027 | 0,13 |
| 100.000 | Volkswagen International Finance NV* | 4,25 % | 29.03.2029 | 114.917 | 0,13 |
| Euro insgesamt | | | | 17.112.649 | 19,72 |
| Britisches Pfund | | | | | |
| 150.000 | Admiral Group Plc* | 8,50 % | 06.01.2034 | 210.462 | 0,24 |
| 225.000 | Barclays Plc* | 7,09 % | 06.11.2029 | 305.794 | 0,35 |
| 152.000 | Barclays Plc* | 8,41 % | 14.11.2032 | 206.909 | 0,24 |
| 539.000 | Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl** | 2,63 % | 20.10.2028 | 587.440 | 0,68 |
| 100.000 | Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl* | 4,88 % | 29.04.2032 | 113.428 | 0,13 |
| 200.000 | British Telecommunications Plc* | 5,75 % | 13.02.2041 | 263.582 | 0,30 |
| 200.000 | Coventry Building Society* | 7,00 % | 07.11.2027 | 265.679 | 0,31 |
| 90.000 | Danske Bank A/S* | 2,25 % | 14.01.2028 | 104.857 | 0,12 |
| 100.000 | Electricite de France SA* | 6,00 % | 29.12.2049 | 124.432 | 0,14 |
| 214.000 | GE Capital UK Funding Unlimited Co* | 8,00 % | 14.01.2039 | 339.541 | 0,39 |
| 130.000 | Holcim Sterling Finance Netherlands BV* | 2,25 % | 04.04.2034 | 128.326 | 0,15 |
| 200.000 | Intesa Sanpaolo SpA* | 5,15 % | 10.06.2030 | 231.274 | 0,27 |
| 100.000 | Intesa Sanpaolo SpA** | 6,63 % | 31.05.2033 | 134.879 | 0,16 |
| 100.000 | Logicor Financing Sarl* | 2,75 % | 15.01.2030 | 105.160 | 0,12 |
| 100.000 | National Grid Electricity Distribution South West Plc* | 5,82 % | 31.07.2041 | 136.597 | 0,16 |
| 115.000 | NatWest Group Plc* | 7,42 % | 06.06.2033 | 153.325 | 0,18 |
| 103.000 | Orsted A/S* | 5,13 % | 13.09.2034 | 130.967 | 0,15 |
| 240.000 | OSB Group Plc* | 9,50 % | 07.09.2028 | 315.151 | 0,36 |
| 300.000 | Pension Insurance Corp Plc* | 8,00 % | 13.11.2033 | 410.434 | 0,47 |
| 165.000 | Phoenix Group Holdings Plc* | 5,63 % | 28.04.2031 | 199.416 | 0,23 |
| 200.000 | Phoenix Group Holdings Plc* | 7,75 % | 06.12.2053 | 267.000 | 0,31 |
| 100.000 | Principality Building Society* | 8,63 % | 12.07.2028 | 138.056 | 0,16 |
| 200.000 | RAC Bond Co Plc* | 8,25 % | 06.11.2028 | 274.881 | 0,32 |
| 200.000 | Rothsay Life Plc* | 7,73 % | 16.05.2033 | 272.271 | 0,31 |
| 113.000 | Santander UK Group Holdings Plc* | 7,10 % | 16.11.2027 | 149.903 | 0,17 |
| 100.000 | SW Finance I Plc* | 7,38 % | 12.12.2041 | 136.882 | 0,16 |
| 100.000 | Thames Water Utilities Finance Plc* | 8,25 % | 25.04.2040 | 143.360 | 0,16 |
| 120.000 | Virgin Money UK Plc* | 5,13 % | 11.12.2030 | 146.851 | 0,17 |
| 215.000 | Virgin Money UK Plc* | 7,63 % | 23.08.2029 | 291.719 | 0,34 |
| 100.000 | Volkswagen Financial Services NV* | 6,50 % | 18.09.2027 | 133.353 | 0,15 |
| Britisches Pfund insgesamt | | | | 6.421.929 | 7,40 |

Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 93,78 % (31. Dezember 2022: 94,02 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 525.000 | AbbVie Inc* | 4,05 % | 21.11.2039 | 474.332 | 0,55 |
| 500.000 | AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust* | 1,75 % | 30.01.2026 | 464.608 | 0,54 |
| 235.000 | AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust* | 3,00 % | 29.10.2028 | 214.667 | 0,25 |
| 180.000 | AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust* | 3,40 % | 29.10.2033 | 154.673 | 0,18 |
| 230.000 | Air Lease Corp* | 3,38 % | 01.07.2025 | 222.733 | 0,26 |
| 305.000 | Air Lease Corp* | 4,63 % | 01.10.2028 | 298.380 | 0,34 |
| 246.058 | American Airlines 2021-1 Class A Pass Through Trust** | 2,88 % | 11.07.2034 | 209.295 | 0,24 |
| 180.000 | American Express Co** | 6,49 % | 30.10.2031 | 195.306 | 0,23 |
| 400.000 | Amgen Inc** | 2,80 % | 15.08.2041 | 291.154 | 0,34 |
| 110.000 | Amgen Inc** | 4,20 % | 22.02.2052 | 93.233 | 0,11 |
| 250.000 | Amgen Inc** | 4,40 % | 01.05.2045 | 222.214 | 0,26 |
| 615.000 | Amgen Inc** | 5,15 % | 02.03.2028 | 629.860 | 0,73 |
| 695.000 | Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc* | 5,45 % | 23.01.2039 | 733.480 | 0,85 |
| 360.000 | Appalachian Power Co** | 3,70 % | 01.05.2050 | 270.111 | 0,31 |
| 255.000 | Apple Inc** | 2,38 % | 08.02.2041 | 186.563 | 0,22 |
| 500.000 | Apple Inc** | 3,45 % | 09.02.2045 | 416.939 | 0,48 |
| 315.000 | AT&T Inc* | 3,50 % | 01.06.2041 | 250.353 | 0,29 |
| 400.000 | AT&T Inc* | 4,35 % | 01.03.2029 | 394.968 | 0,46 |
| 1.000.000 | Athene Global Funding** | 1,61 % | 29.06.2026 | 905.681 | 1,04 |
| 215.000 | Baltimore Gas & Electric Co** | 4,55 % | 01.06.2052 | 197.359 | 0,23 |
| 685.000 | Bank of America Corp** | 1,90 % | 23.07.2031 | 560.729 | 0,65 |
| 415.000 | Bank of America Corp** | 2,59 % | 29.04.2031 | 357.875 | 0,41 |
| 400.000 | Barclays Plc* | 2,85 % | 07.05.2026 | 385.827 | 0,44 |
| 200.000 | Barclays Plc* | 2,89 % | 24.11.2032 | 164.029 | 0,19 |
| 275.000 | Barclays Plc* | 4,97 % | 16.05.2029 | 270.223 | 0,31 |
| 125.000 | Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada* | 5,10 % | 11.05.2033 | 128.337 | 0,15 |
| 500.000 | BNP Paribas SA** | 2,22 % | 09.06.2026 | 477.561 | 0,55 |
| 275.000 | BNP Paribas SA** | 4,25 % | 15.10.2024 | 271.990 | 0,31 |
| 185.000 | Boeing Co* | 3,63 % | 01.02.2031 | 171.916 | 0,20 |
| 260.000 | Boeing Co* | 5,71 % | 01.05.2040 | 269.091 | 0,31 |
| 205.000 | Boeing Co* | 5,81 % | 01.05.2050 | 212.432 | 0,24 |
| 160.000 | Boeing Co* | 5,93 % | 01.05.2060 | 165.965 | 0,19 |
| 200.000 | Bristol-Myers Squibb Co** | 4,35 % | 15.11.2047 | 176.541 | 0,20 |
| 190.000 | Bristol-Myers Squibb Co* | 6,40 % | 15.11.2063 | 220.349 | 0,25 |
| 335.000 | Capital One Financial Corp* | 4,20 % | 29.10.2025 | 328.712 | 0,38 |
| 125.000 | Carrier Global Corp** | 5,90 % | 15.03.2034 | 135.571 | 0,16 |
| 450.000 | CDW LLC/CDW Finance Corp** | 3,57 % | 01.12.2031 | 399.686 | 0,46 |
| 460.000 | Centene Corp* | 2,45 % | 15.07.2028 | 410.023 | 0,47 |
| 460.000 | Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital** | 2,25 % | 15.01.2029 | 399.391 | 0,46 |
| 185.000 | Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital** | 2,80 % | 01.04.2031 | 156.173 | 0,18 |

Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 93,78 % (31. Dezember 2022: 94,02 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 330.000 | Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital** | 4,80 % | 01.03.2050 | 255.867 | 0,29 |
| 185.000 | Cigna Group* | 4,90 % | 15.12.2048 | 176.094 | 0,20 |
| 285.000 | Citibank NA** | 5,80 % | 29.09.2028 | 297.761 | 0,34 |
| 435.000 | Citigroup Inc** | 3,89 % | 10.01.2028 | 420.884 | 0,49 |
| 275.000 | Citigroup Inc** | 4,41 % | 31.03.2031 | 263.252 | 0,30 |
| 210.000 | Citigroup Inc** | 6,17 % | 25.05.2034 | 217.384 | 0,25 |
| 120.000 | CNH Industrial Capital LLC* | 5,45 % | 14.10.2025 | 120.589 | 0,14 |
| 200.000 | Comcast Corp** | 3,40 % | 15.07.2046 | 155.125 | 0,18 |
| 380.000 | Comcast Corp** | 3,75 % | 01.04.2040 | 327.083 | 0,38 |
| 480.000 | Comcast Corp** | 4,80 % | 15.05.2033 | 486.202 | 0,56 |
| 250.000 | Constellation Brands Inc* | 3,15 % | 01.08.2029 | 232.540 | 0,27 |
| 520.000 | Constellation Brands Inc* | 4,75 % | 09.05.2032 | 518.363 | 0,60 |
| 535.000 | Cooperatieve Rabobank UA** | 5,50 % | 18.07.2025 | 540.958 | 0,62 |
| 235.000 | Corebridge Financial Inc* | 5,75 % | 15.01.2034 | 240.386 | 0,28 |
| 540.000 | Cox Communications Inc** | 5,70 % | 15.06.2033 | 562.948 | 0,65 |
| 500.000 | CVS Health Corp* | 2,70 % | 21.08.2040 | 356.765 | 0,41 |
| 225.000 | CVS Health Corp* | 5,05 % | 25.03.2048 | 210.639 | 0,24 |
| 445.000 | CVS Health Corp* | 5,13 % | 21.02.2030 | 452.167 | 0,52 |
| 700.000 | Dell International LLC/EMC Corp** | 5,30 % | 01.10.2029 | 721.393 | 0,83 |
| 452.000 | Dominion Energy Inc* | 3,07 % | 15.08.2024 | 444.695 | 0,51 |
| 520.000 | Dominion Energy Inc* | 5,38 % | 15.11.2032 | 534.351 | 0,62 |
| 405.000 | DTE Energy Co** | 2,53 % | 01.10.2024 | 395.708 | 0,46 |
| 250.000 | Emerson Electric Co* | 2,80 % | 21.12.2051 | 172.007 | 0,20 |
| 370.000 | Enbridge Inc* | 5,70 % | 08.03.2033 | 384.733 | 0,44 |
| 335.000 | Energy Transfer LP* | 6,55 % | 01.12.2033 | 364.026 | 0,42 |
| 200.000 | Entergy Corp* | 3,75 % | 15.06.2050 | 151.270 | 0,17 |
| 190.000 | Equitable Holdings Inc** | 5,00 % | 20.04.2048 | 176.784 | 0,20 |
| 300.000 | Exelon Corp** | 4,45 % | 15.04.2046 | 262.098 | 0,30 |
| 640.000 | F&G Global Funding** | 5,15 % | 07.07.2025 | 631.025 | 0,73 |
| 400.000 | Ford Motor Credit Co LLC* | 6,80 % | 07.11.2028 | 418.796 | 0,48 |
| 165.000 | Fox Corp** | 6,50 % | 13.10.2033 | 178.707 | 0,21 |
| 640.000 | GE HealthCare Technologies Inc** | 5,60 % | 15.11.2025 | 645.880 | 0,74 |
| 190.000 | General Motors Financial Co Inc* | 3,60 % | 21.06.2030 | 172.532 | 0,20 |
| 200.000 | General Motors Financial Co Inc* | 5,80 % | 23.06.2028 | 205.664 | 0,24 |
| 100.000 | Gilead Sciences Inc** | 5,25 % | 15.10.2033 | 104.275 | 0,12 |
| 115.000 | Gilead Sciences Inc** | 5,55 % | 15.10.2053 | 124.707 | 0,14 |
| 470.000 | Goldman Sachs Group Inc** | 1,54 % | 10.09.2027 | 426.486 | 0,49 |
| 900.000 | Goldman Sachs Group Inc** | 3,81 % | 23.04.2029 | 854.979 | 0,99 |
| 400.000 | Home Depot Inc* | 4,25 % | 01.04.2046 | 361.894 | 0,42 |
| 1.125.000 | HSBC Holdings Plc* | 2,01 % | 22.09.2028 | 1.002.020 | 1,15 |

Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 93,78 % (31. Dezember 2022: 94,02 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 195.000 | Humana Inc** | 5,50 % | 15.03.2053 | 202.648 | 0,23 |
| 410.000 | Intel Corp** | 4,88 % | 10.02.2028 | 417.079 | 0,48 |
| 185.000 | Intel Corp** | 4,90 % | 05.08.2052 | 181.241 | 0,21 |
| 120.000 | Intel Corp** | 5,70 % | 10.02.2053 | 129.858 | 0,15 |
| 160.000 | International Business Machines Corp* | 4,00 % | 20.06.2042 | 139.459 | 0,16 |
| 285.000 | Intesa Sanpaolo SpA** | 7,78 % | 20.06.2054 | 296.555 | 0,34 |
| 200.000 | Intesa Sanpaolo SpA** | 8,25 % | 21.11.2033 | 217.194 | 0,25 |
| 585.000 | ITC Holdings Corp** | 2,95 % | 14.05.2030 | 515.549 | 0,59 |
| 205.000 | John Deere Capital Corp* | 4,95 % | 14.07.2028 | 210.296 | 0,24 |
| 415.000 | JPMorgan Chase & Co** | 0,97 % | 23.06.2025 | 405.373 | 0,47 |
| 230.000 | JPMorgan Chase & Co** | 1,47 % | 22.09.2027 | 208.475 | 0,24 |
| 500.000 | JPMorgan Chase & Co** | 2,30 % | 15.10.2025 | 487.308 | 0,56 |
| 900.000 | JPMorgan Chase & Co** | 4,01 % | 23.04.2029 | 866.653 | 1,00 |
| 155.000 | JPMorgan Chase & Co** | 6,25 % | 23.10.2034 | 168.108 | 0,19 |
| 410.000 | Kenvue Inc** | 5,00 % | 22.03.2030 | 423.529 | 0,49 |
| 145.000 | Kinder Morgan Inc* | 5,55 % | 01.06.2045 | 139.745 | 0,16 |
| 280.000 | KLA Corp** | 4,95 % | 15.07.2052 | 283.186 | 0,33 |
| 250.000 | L3Harris Technologies Inc* | 5,40 % | 15.01.2027 | 255.310 | 0,29 |
| 250.000 | L3Harris Technologies Inc* | 5,40 % | 31.07.2033 | 260.051 | 0,30 |
| 520.000 | Lloyds Banking Group Plc* | 3,87 % | 09.07.2025 | 515.190 | 0,59 |
| 230.000 | Lloyds Banking Group Plc* | 7,95 % | 15.11.2033 | 263.137 | 0,30 |
| 275.000 | Lowe's Cos Inc* | 3,00 % | 15.10.2050 | 187.300 | 0,22 |
| 230.000 | Lowe's Cos Inc* | 3,75 % | 01.04.2032 | 215.364 | 0,25 |
| 400.000 | Marathon Petroleum Corp** | 4,70 % | 01.05.2025 | 397.619 | 0,46 |
| 315.000 | Mars Inc** | 4,55 % | 20.04.2028 | 316.897 | 0,37 |
| 325.000 | Marvell Technology Inc** | 5,75 % | 15.02.2029 | 336.015 | 0,39 |
| 125.000 | Marvell Technology Inc** | 5,95 % | 15.09.2033 | 132.647 | 0,15 |
| 285.000 | McDonald's Corp* | 3,63 % | 01.09.2049 | 228.715 | 0,26 |
| 400.000 | Mercedes-Benz Finance North America LLC** | 5,25 % | 29.11.2027 | 408.995 | 0,47 |
| 85.000 | Merck & Co Inc* | 2,90 % | 10.12.2061 | 56.869 | 0,07 |
| 305.000 | Meta Platforms Inc** | 5,60 % | 15.05.2053 | 330.814 | 0,38 |
| 330.000 | Mohawk Industries Inc* | 5,85 % | 18.09.2028 | 342.382 | 0,39 |
| 370.000 | Molson Coors Beverage Co* | 3,00 % | 15.07.2026 | 354.577 | 0,41 |
| 240.000 | Morgan Stanley** | 1,93 % | 28.04.2032 | 193.090 | 0,22 |
| 500.000 | Morgan Stanley** | 2,70 % | 22.01.2031 | 437.403 | 0,50 |
| 405.000 | Morgan Stanley** | 5,12 % | 01.02.2029 | 407.070 | 0,47 |
| 375.000 | Mosaic Co* | 5,38 % | 15.11.2028 | 383.048 | 0,44 |
| 265.000 | MPLX LP* | 5,00 % | 01.03.2033 | 259.734 | 0,30 |
| 605.000 | Nationwide Building Society* | 6,56 % | 18.10.2027 | 626.651 | 0,72 |
| 410.000 | NatWest Group Plc* | 5,81 % | 13.09.2029 | 420.780 | 0,49 |

Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 93,78 % (31. Dezember 2022: 94,02 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 310.000 | NextEra Energy Capital Holdings Inc [*] | 5,25 % | 28.02.2053 | 305.115 | 0,35 |
| 300.000 | NXP BV/NXP Funding LLC/NXP USA Inc ^{**} | 4,30 % | 18.06.2029 | 291.678 | 0,34 |
| 150.000 | NXP BV/NXP Funding LLC/NXP USA Inc ^{**} | 5,00 % | 15.01.2033 | 150.331 | 0,17 |
| 285.000 | Occidental Petroleum Corp [*] | 6,13 % | 01.01.2031 | 296.231 | 0,34 |
| 380.000 | Occidental Petroleum Corp ^{**} | 6,45 % | 15.09.2036 | 402.569 | 0,46 |
| 500.000 | Oracle Corp [*] | 2,88 % | 25.03.2031 | 443.161 | 0,51 |
| 200.000 | Oracle Corp [*] | 4,00 % | 15.07.2046 | 160.664 | 0,19 |
| 260.000 | Oracle Corp [*] | 4,90 % | 06.02.2033 | 258.960 | 0,30 |
| 440.000 | Oracle Corp [*] | 6,15 % | 09.11.2029 | 473.663 | 0,55 |
| 205.000 | PACCAR Financial Corp ^{**} | 4,95 % | 10.08.2028 | 211.615 | 0,24 |
| 190.000 | Pacific Gas & Electric Co [*] | 6,95 % | 15.03.2034 | 208.946 | 0,24 |
| 390.000 | Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd [*] | 5,11 % | 19.05.2043 | 388.849 | 0,45 |
| 295.000 | Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd [*] | 5,34 % | 19.05.2063 | 298.076 | 0,34 |
| 185.000 | Phillips 66 [*] | 3,30 % | 15.03.2052 | 132.678 | 0,15 |
| 130.000 | PNC Financial Services Group Inc ^{**} | 6,62 % | 20.10.2027 | 134.907 | 0,16 |
| 155.000 | PNC Financial Services Group Inc ^{**} | 6,88 % | 20.10.2034 | 172.137 | 0,20 |
| 285.000 | Public Service Enterprise Group Inc [*] | 6,13 % | 15.10.2033 | 306.576 | 0,35 |
| 260.000 | QUALCOMM Inc ^{**} | 6,00 % | 20.05.2053 | 299.451 | 0,35 |
| 220.000 | Quest Diagnostics Inc [*] | 6,40 % | 30.11.2033 | 244.090 | 0,28 |
| 575.000 | Rogers Communications Inc ^{**} | 4,50 % | 15.03.2042 | 507.884 | 0,59 |
| 355.000 | Rogers Communications Inc [*] | 5,00 % | 15.03.2044 | 334.171 | 0,39 |
| 225.000 | RTX Corp [*] | 4,63 % | 16.11.2048 | 205.667 | 0,24 |
| 155.000 | RTX Corp [*] | 6,40 % | 15.03.2054 | 179.569 | 0,21 |
| 500.000 | Societe Generale SA ^{**} | 3,63 % | 01.03.2041 | 341.549 | 0,39 |
| 155.000 | Southern California Edison Co [*] | 4,88 % | 01.03.2049 | 142.503 | 0,16 |
| 320.000 | Southern Co [*] | 4,85 % | 15.06.2028 | 322.611 | 0,37 |
| 315.000 | Sprint Capital Corp ^{**} | 8,75 % | 15.03.2032 | 389.163 | 0,45 |
| 250.000 | Synchrony Bank [*] | 5,40 % | 22.08.2025 | 246.387 | 0,28 |
| 370.000 | Takeda Pharmaceutical Co Ltd ^{**} | 3,03 % | 09.07.2040 | 284.598 | 0,33 |
| 500.000 | T-Mobile USA Inc ^{**} | 3,75 % | 15.04.2027 | 485.114 | 0,56 |
| 140.000 | T-Mobile USA Inc ^{**} | 4,50 % | 15.04.2050 | 123.828 | 0,14 |
| 235.000 | T-Mobile USA Inc ^{**} | 5,80 % | 15.09.2062 | 252.294 | 0,29 |
| 145.000 | Truist Financial Corp ^{**} | 5,87 % | 08.06.2034 | 148.015 | 0,17 |
| 200.000 | Tucson Electric Power Co [*] | 3,25 % | 01.05.2051 | 138.127 | 0,16 |
| 380.000 | Union Pacific Corp [*] | 3,20 % | 20.05.2041 | 304.579 | 0,35 |
| 1.164.570 | United Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust ^{**} | 5,88 % | 15.10.2027 | 1.180.402 | 1,36 |
| 383.000 | United Airlines 2023-1 Class A Pass Through Trust ^{**} | 5,80 % | 15.01.2036 | 389.897 | 0,45 |
| 255.000 | UnitedHealth Group Inc [*] | 5,20 % | 15.04.2063 | 260.591 | 0,30 |
| 155.000 | UnitedHealth Group Inc [*] | 6,05 % | 15.02.2063 | 179.013 | 0,21 |
| 450.000 | Verizon Communications Inc [*] | 2,85 % | 03.09.2041 | 332.785 | 0,38 |

Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|----------------------------------|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 93,78 % (31. Dezember 2022: 94,02 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 400.000 | Vodafone Group Plc** | 4,38 % | 19.02.2043 | 349.152 | 0,40 |
| 185.000 | Vodafone Group Plc** | 4,88 % | 19.06.2049 | 167.895 | 0,19 |
| 260.000 | Walmart Inc* | 4,50 % | 15.04.2053 | 252.926 | 0,29 |
| 285.000 | Walt Disney Co* | 3,60 % | 13.01.2051 | 229.286 | 0,26 |
| 225.000 | Warnermedia Holdings Inc** | 3,76 % | 15.03.2027 | 215.672 | 0,25 |
| 205.000 | Warnermedia Holdings Inc** | 5,05 % | 15.03.2042 | 180.826 | 0,21 |
| 250.000 | Waste Management Inc* | 4,88 % | 15.02.2029 | 256.000 | 0,30 |
| 250.000 | Waste Management Inc* | 4,88 % | 15.02.2034 | 255.146 | 0,29 |
| 1.090.000 | WEC Energy Group Inc* | 4,75 % | 09.01.2026 | 1.086.194 | 1,25 |
| 305.000 | Wells Fargo & Co** | 5,57 % | 25.07.2029 | 311.607 | 0,36 |
| 455.000 | Wells Fargo & Co** | 6,30 % | 23.10.2029 | 479.816 | 0,55 |
| 80.000 | Westlake Corp* | 3,38 % | 15.08.2061 | 51.618 | 0,06 |
| 365.000 | Zimmer Biomet Holdings Inc* | 3,05 % | 15.01.2026 | 352.508 | 0,41 |
| US-Dollar insgesamt | | | | 55.796.371 | 64,30 |
| Unternehmensanleihen insgesamt | | | | 81.376.321 | 93,78 |
| Staatsanleihen 2,40 % (31. Dezember 2022: 3,21 %) | | | | | |
| Euro | | | | | |
| 530.000 | European Union | 0,80 % | 04.07.2025 | 568.053 | 0,65 |
| 175.000 | European Union | 2,00 % | 04.10.2027 | 190.483 | 0,22 |
| Euro insgesamt | | | | 758.536 | 0,87 |
| US-Dollar | | | | | |
| 250.000 | United States Treasury Note/Bond | 4,13 % | 15.08.2053 | 252.774 | 0,29 |
| 635.000 | United States Treasury Note/Bond | 4,38 % | 15.12.2026 | 641.300 | 0,74 |
| 420.000 | United States Treasury Note/Bond | 4,38 % | 30.11.2028 | 429.844 | 0,50 |
| US-Dollar insgesamt | | | | 1.323.918 | 1,53 |
| Staatsanleihen insgesamt * | | | | 2.082.454 | 2,40 |
| Anlagen insgesamt | | | | 83.458.775 | 96,18 |

Devisenterminkontrakte 0,00 % (31. Dezember 2022: 0,01 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeits- datum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|------------------------|-----------------------|-------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 27.800 € | 29.627 US\$ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 4 | 1.101 | 0,00 |
| 1.047 € | 1.143 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 4 | 14 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ^{oo} | | | | | 1.115 | 0,00 |

Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|-------------------|------------------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 83.459.890 | 96,18 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (1,28 %) (31. Dezember 2022: (1,91 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettövermögens |
|--|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 5.341 US\$ | 5.000 € | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | (186) | (0,00) |
| 432.310 US\$ | 395.834 € | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | (5.220) | (0,01) |
| 6.987.605 US\$ | 5.723.090 £ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | (308.829) | (0,36) |
| 1.940.938 US\$ | 2.640.019 CAD | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (61.656) | (0,07) |
| 1.112 US\$ | 1.050 € | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (49) | (0,00) |
| 359.825 US\$ | 283.497 £ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (1.609) | (0,00) |
| 17.008.463 US\$ | 16.047.911 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | (729.896) | (0,84) |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 181 € | 201 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (0) | (0,00) |
| 165 US\$ | 153 € | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | (5) | (0,00) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | (1.107.450) | (1,28) |

| | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|---|--------------------|------------------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (1.107.450) | (1,28) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | 82.352.440 | 94,90 |
| Sonstiges Nettovermögen | 4.425.385 | 5,10 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | 86.777.825 | 100,00 |

| Portfolioanalyse | US\$ | % des Gesamtver- mögens |
|---|-------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 50.897.570 | 57,87 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 30.737.422 | 34,95 |
| † Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente | 1.823.783 | 2,07 |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente | (1.106.335) | (1,26) |
| Anlagen insgesamt | 82.352.440 | 93,63 |

Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|---|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 2,78 % (31. Dezember 2022: 5,64 %) | | | | | |
| Euro | | | | | |
| 76.813 | European Residential Loan Securitisation 2019-NPL2 DAC Class A | 6,88 % | 24.02.2058 | 84.280 | 0,13 |
| 161.283 | FTA Santander Consumo 4 Class C | 2,20 % | 18.09.2032 | 169.848 | 0,26 |
| 118.199 | Futura S.r.l. 2019-1 Class A | 6,97 % | 31.07.2044 | 130.107 | 0,20 |
| Euro insgesamt | | | | 384.235 | 0,59 |
| Britisches Pfund | | | | | |
| 53.220 | Towd Point Mortgage Funding 2018 - Auburn 12 Plc Class A | 6,69 % | 20.02.2045 | 67.935 | 0,10 |
| Britisches Pfund insgesamt | | | | 67.935 | 0,10 |
| US-Dollar | | | | | |
| 183.840 | Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 1M2 | 8,10 % | 25.02.2030 | 189.062 | 0,29 |
| 132.535 | Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 2M2 | 7,65 % | 25.08.2030 | 134.544 | 0,20 |
| 445.617 | Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes Class M2 | 7,25 % | 25.07.2030 | 448.678 | 0,69 |
| 147.123 | Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes Class M2 | 7,80 % | 25.04.2030 | 150.100 | 0,23 |
| 428.781 | Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes Class M2 | 8,70 % | 25.07.2029 | 443.189 | 0,68 |
| US-Dollar insgesamt | | | | 1.365.573 | 2,09 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt ** | | | | 1.817.743 | 2,78 |
| Unternehmensanleihen 41,91 % (31. Dezember 2022: 46,55 %) | | | | | |
| Euro | | | | | |
| 100.000 | 888 Acquisitions Ltd** | 7,56 % | 15.07.2027 | 105.742 | 0,16 |
| 100.000 | Abertis Infraestructuras Finance BV* | 3,25 % | 29.12.2049 | 106.312 | 0,16 |
| 100.000 | Adevinta ASA* | 3,00 % | 15.11.2027 | 110.184 | 0,17 |
| 150.000 | Allwyn International AS** | 3,88 % | 15.02.2027 | 159.898 | 0,24 |
| 100.000 | Altice Financing SA** | 4,25 % | 15.08.2029 | 98.335 | 0,15 |
| 147.000 | Altice France Holding SA* | 4,00 % | 15.02.2028 | 72.398 | 0,11 |
| 100.000 | Altice France SA** | 4,13 % | 15.01.2029 | 88.599 | 0,14 |
| 100.000 | American Tower Corp* | 0,88 % | 21.05.2029 | 96.447 | 0,15 |
| 150.000 | Anheuser-Busch InBev SA* | 2,00 % | 23.01.2035 | 148.937 | 0,23 |
| 130.000 | Anheuser-Busch InBev SA* | 2,75 % | 17.03.2036 | 137.397 | 0,21 |
| 120.000 | Apple Inc* | 0,50 % | 15.11.2031 | 113.276 | 0,17 |
| 100.000 | Aramark International Finance Sarl* | 3,13 % | 01.04.2025 | 110.220 | 0,17 |
| 150.000 | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc* | 3,00 % | 01.09.2029 | 134.069 | 0,20 |
| 139.000 | Ashland Services BV** | 2,00 % | 30.01.2028 | 143.047 | 0,22 |
| 100.000 | Assemblin Group AB** | 8,96 % | 05.07.2029 | 112.373 | 0,17 |
| 100.000 | Avantor Funding Inc* | 3,88 % | 15.07.2028 | 108.504 | 0,17 |
| 100.000 | Avis Budget Finance Plc** | 7,25 % | 31.07.2030 | 118.589 | 0,18 |
| 100.000 | Banco Santander SA* | 4,88 % | 18.10.2031 | 117.776 | 0,18 |

Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 41,91 % (31. Dezember 2022: 46,55 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Euro (Fortsetzung) | | | | | |
| 103.000 | Banijay Entertainment SASU** | 7,00 % | 01.05.2029 | 120.307 | 0,18 |
| 107.000 | Banijay Group SAS** | 6,50 % | 01.03.2026 | 118.365 | 0,18 |
| 300.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA* | 1,25 % | 03.06.2030 | 287.201 | 0,44 |
| 270.000 | Barclays Plc* | 0,58 % | 09.08.2029 | 257.015 | 0,39 |
| 100.000 | Bayer AG* | 2,38 % | 12.11.2079 | 106.232 | 0,16 |
| 100.000 | Bayer AG* | 5,38 % | 25.03.2082 | 105.272 | 0,16 |
| 100.000 | Bayerische Landesbank* | 7,00 % | 05.01.2034 | 114.630 | 0,18 |
| 178.000 | BCP V Modular Services Finance Plc** | 6,75 % | 30.11.2029 | 162.048 | 0,25 |
| 100.000 | Benteler International AG* | 9,38 % | 15.05.2028 | 118.283 | 0,18 |
| 100.000 | Birkenstock Financing Sarl* | 5,25 % | 30.04.2029 | 110.171 | 0,17 |
| 100.000 | Boels Topholding BV** | 6,25 % | 15.02.2029 | 115.717 | 0,18 |
| 171.000 | Booking Holdings Inc* | 0,50 % | 08.03.2028 | 171.492 | 0,26 |
| 100.000 | BUPA Finance Plc* | 5,00 % | 12.10.2030 | 118.891 | 0,18 |
| 100.000 | Carmila SA* | 5,50 % | 09.10.2028 | 114.663 | 0,18 |
| 100.000 | CECONOMY AG* | 1,75 % | 24.06.2026 | 96.267 | 0,15 |
| 100.000 | Cellnex Finance Co SA* | 1,50 % | 08.06.2028 | 101.404 | 0,15 |
| 150.000 | Cheplapharm Arzneimittel GmbH** | 4,38 % | 15.01.2028 | 161.932 | 0,25 |
| 100.000 | Cirsa Finance International Sarl* | 7,88 % | 31.07.2028 | 115.543 | 0,18 |
| 100.000 | Constellium SE* | 4,25 % | 15.02.2026 | 110.187 | 0,17 |
| 100.000 | Coty Inc** | 3,88 % | 15.04.2026 | 110.496 | 0,17 |
| 100.000 | CPI Property Group SA* | 1,75 % | 14.01.2030 | 63.146 | 0,10 |
| 100.000 | Ctec II GmbH** | 5,25 % | 15.02.2030 | 99.255 | 0,15 |
| 100.000 | Dana Financing Luxembourg Sarl* | 8,50 % | 15.07.2031 | 121.180 | 0,19 |
| 100.000 | Deutsche Lufthansa AG* | 3,00 % | 29.05.2026 | 107.760 | 0,16 |
| 100.000 | Deutsche Lufthansa AG* | 3,75 % | 11.02.2028 | 109.230 | 0,17 |
| 200.000 | Digital Intrepid Holding BV* | 0,63 % | 15.07.2031 | 173.715 | 0,27 |
| 100.000 | Douglas GmbH* | 6,00 % | 08.04.2026 | 109.463 | 0,17 |
| 200.000 | EDP - Energias de Portugal SA* | 5,94 % | 23.04.2083 | 229.884 | 0,35 |
| 400.000 | Electricite de France SA* | 7,50 % | 29.12.2049 | 483.505 | 0,74 |
| 150.000 | Emerald Debt Merger Sub LLC† | 6,38 % | 15.12.2030 | 177.636 | 0,27 |
| 270.000 | EnBW International Finance BV* | 0,13 % | 01.03.2028 | 269.208 | 0,41 |
| 100.000 | Enel SpA* | 6,38 % | 29.12.2049 | 115.760 | 0,18 |
| 127.000 | Energia Group Roi Financeco DAC** | 6,88 % | 31.07.2028 | 145.983 | 0,22 |
| 100.000 | Energizer Gamma Acquisition BV** | 3,50 % | 30.06.2029 | 95.548 | 0,15 |
| 100.000 | Ephios Subco 3 Sarl** | 7,88 % | 31.01.2031 | 114.517 | 0,18 |
| 100.000 | Eroski S Coop* | 10,63 % | 30.04.2029 | 114.089 | 0,17 |
| 100.000 | Fastighets AB Balder* | 2,87 % | 02.06.2081 | 83.656 | 0,13 |
| 100.000 | Fiber Bidco SpA* | 11,00 % | 25.10.2027 | 120.882 | 0,18 |
| 100.000 | Ford Motor Credit Co LLC* | 4,87 % | 03.08.2027 | 113.667 | 0,17 |

Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 41,91 % (31. Dezember 2022: 46,55 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Euro (Fortsetzung) | | | | | |
| 100.000 | Fiserv Inc [*] | 1,63 % | 01.07.2030 | 100.065 | 0,15 |
| 100.000 | Forvia SE [*] | 2,38 % | 15.06.2027 | 104.740 | 0,16 |
| 100.000 | Grifols SA [*] | 1,63 % | 15.02.2025 | 108.393 | 0,17 |
| 100.000 | Gruenthal GmbH ^{**} | 4,13 % | 15.05.2028 | 109.588 | 0,17 |
| 100.000 | Grupo Antolin-Irausa SA [*] | 3,50 % | 30.04.2028 | 84.322 | 0,13 |
| 100.000 | Guala Closures SpA [*] | 3,25 % | 15.06.2028 | 104.209 | 0,16 |
| 235.000 | Haleon Netherlands Capital BV [*] | 1,75 % | 29.03.2030 | 239.777 | 0,37 |
| 150.000 | Heimstaden Bostad AB [*] | 3,25 % | 29.12.2049 | 87.056 | 0,13 |
| 100.000 | Heimstaden Bostad Treasury BV [*] | 1,38 % | 24.07.2028 | 79.601 | 0,12 |
| 200.000 | IHO Verwaltungs GmbH [*] | 3,88 % | 15.05.2027 | 216.944 | 0,33 |
| 100.000 | Iliad Holding SASU ^{**} | 5,13 % | 15.10.2026 | 110.393 | 0,17 |
| 100.000 | iliad SA [*] | 5,38 % | 14.06.2027 | 113.710 | 0,17 |
| 100.000 | Imerys SA [*] | 4,75 % | 29.11.2029 | 112.361 | 0,17 |
| 200.000 | INEOS Quattro Finance 1 Plc [*] | 3,75 % | 15.07.2026 | 213.873 | 0,33 |
| 100.000 | International Consolidated Airlines Group SA [*] | 3,75 % | 25.03.2029 | 107.086 | 0,16 |
| 100.000 | Intrum AB [*] | 3,00 % | 15.09.2027 | 84.477 | 0,13 |
| 100.000 | IPD 3 BV [*] | 8,00 % | 15.06.2028 | 118.206 | 0,18 |
| 100.000 | Jaguar Land Rover Automotive Plc [*] | 4,50 % | 15.07.2028 | 108.159 | 0,17 |
| 200.000 | JPMorgan Chase & Co [*] | 4,46 % | 13.11.2031 | 233.082 | 0,36 |
| 100.000 | Kapla Holding SAS [*] | 3,38 % | 15.12.2026 | 107.204 | 0,16 |
| 100.000 | Koninklijke KPN NV [*] | 6,00 % | 29.12.2049 | 114.730 | 0,18 |
| 59.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau [*] | 0,00 % | 15.06.2026 | 61.383 | 0,09 |
| 21.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau [*] | 0,00 % | 15.09.2031 | 19.222 | 0,03 |
| 27.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau [*] | 0,01 % | 05.05.2027 | 27.561 | 0,04 |
| 18.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau ^{**} | 0,38 % | 09.03.2026 | 19.003 | 0,03 |
| 47.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau ^{**} | 0,75 % | 28.06.2028 | 48.302 | 0,07 |
| 32.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau [*] | 0,75 % | 15.01.2029 | 32.572 | 0,05 |
| 46.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau [*] | 1,25 % | 30.06.2027 | 48.865 | 0,07 |
| 100.000 | LHMC Finco 2 Sarl [*] | 7,25 % | 02.10.2025 | 110.065 | 0,17 |
| 200.000 | Lorca Telecom Bondco SA [*] | 4,00 % | 18.09.2027 | 216.235 | 0,33 |
| 100.000 | Lottomatica SpA ^{**} | 7,13 % | 01.06.2028 | 116.710 | 0,18 |
| 100.000 | Loxam SAS [*] | 5,75 % | 15.07.2027 | 109.040 | 0,17 |
| 100.000 | McDonald's Corp [*] | 4,13 % | 28.11.2035 | 116.734 | 0,18 |
| 100.000 | Medtronic Global Holdings SCA [*] | 1,38 % | 15.10.2040 | 81.322 | 0,12 |
| 150.000 | Molson Coors Beverage Co [*] | 1,25 % | 15.07.2024 | 163.256 | 0,25 |
| 100.000 | Mooney Group SpA ^{**} | 7,81 % | 17.12.2026 | 108.920 | 0,17 |
| 100.000 | Morgan Stanley [*] | 0,50 % | 26.10.2029 | 95.474 | 0,15 |
| 100.000 | Motion Finco Sarl ^{**} | 7,38 % | 15.06.2030 | 113.192 | 0,17 |
| 100.000 | Multiversity SRL [*] | 8,20 % | 30.10.2028 | 111.155 | 0,17 |
| 100.000 | National Grid North America Inc [*] | 4,67 % | 12.09.2033 | 118.084 | 0,18 |

Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 41,91 % (31. Dezember 2022: 46,55 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Euro (Fortsetzung) | | | | | |
| 150.000 | Nidda Healthcare Holding GmbH** | 7,50 % | 21.08.2026 | 171.131 | 0,26 |
| 100.000 | Olympus Water US Holding Corp* | 3,88 % | 01.10.2028 | 101.545 | 0,16 |
| 100.000 | PCF GmbH* | 4,75 % | 15.04.2026 | 81.027 | 0,12 |
| 100.000 | PEU Finance Plc* | 7,25 % | 01.07.2028 | 113.946 | 0,17 |
| 100.000 | Piaggio & C SpA* | 6,50 % | 05.10.2030 | 116.844 | 0,18 |
| 100.000 | PrestigeBidCo GmbH** | 9,97 % | 15.07.2027 | 112.444 | 0,17 |
| 100.000 | Q-Park Holding I BV** | 1,50 % | 01.03.2025 | 108.471 | 0,17 |
| 100.000 | RCS & RDS SA* | 2,50 % | 05.02.2025 | 108.313 | 0,17 |
| 100.000 | Sandoz Finance BV* | 4,50 % | 17.11.2033 | 117.380 | 0,18 |
| 100.000 | SES SA* | 5,63 % | 29.12.2049 | 110.651 | 0,17 |
| 100.000 | Southern Co* | 1,88 % | 15.09.2081 | 95.010 | 0,15 |
| 87.920 | Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH** | 6,00 % | 30.07.2026 | 97.196 | 0,15 |
| 100.000 | Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH** | 2,00 % | 15.07.2025 | 108.314 | 0,17 |
| 100.000 | Telecom Italia SpA* | 2,38 % | 12.10.2027 | 103.494 | 0,16 |
| 100.000 | Telecom Italia SpA* | 2,88 % | 28.01.2026 | 107.147 | 0,16 |
| 100.000 | Telecom Italia SpA* | 7,88 % | 31.07.2028 | 122.993 | 0,19 |
| 100.000 | Telefonica Europe BV* | 2,88 % | 29.12.2049 | 103.127 | 0,16 |
| 200.000 | Telefonica Europe BV* | 3,88 % | 29.12.2049 | 214.356 | 0,33 |
| 36.667 | Tendam Brands SAU* | 11,45 % | 31.03.2028 | 41.253 | 0,06 |
| 150.000 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV* | 1,63 % | 15.10.2028 | 141.664 | 0,22 |
| 100.000 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV* | 6,00 % | 31.01.2025 | 111.818 | 0,17 |
| 100.000 | Thames Water Utilities Finance Plc* | 4,38 % | 18.01.2031 | 104.783 | 0,16 |
| 100.000 | Titan Holdings II BV* | 5,13 % | 15.07.2029 | 95.140 | 0,15 |
| 92.700 | TK Elevator Holdco GmbH** | 6,63 % | 15.07.2028 | 94.834 | 0,14 |
| 100.000 | TMNL Holding BV** | 3,75 % | 15.01.2029 | 105.152 | 0,16 |
| 205.000 | Toronto-Dominion Bank* | 3,13 % | 03.08.2032 | 221.868 | 0,34 |
| 115.000 | Trivium Packaging Finance BV* | 3,75 % | 15.08.2026 | 123.323 | 0,19 |
| 150.000 | UGI International LLC** | 2,50 % | 01.12.2029 | 141.515 | 0,22 |
| 100.000 | United Group BV** | 5,25 % | 01.02.2030 | 104.982 | 0,16 |
| 270.000 | Utah Acquisition Sub Inc* | 3,13 % | 22.11.2028 | 290.961 | 0,44 |
| 100.000 | Valeo SE* | 5,88 % | 12.04.2029 | 118.722 | 0,18 |
| 200.000 | Veolia Environnement SA* | 2,50 % | 29.12.2049 | 198.274 | 0,30 |
| 200.000 | Verisure Holding AB* | 3,25 % | 15.02.2027 | 212.622 | 0,32 |
| 100.000 | Verisure Midholding AB* | 5,25 % | 15.02.2029 | 105.749 | 0,16 |
| 370.000 | Verizon Communications Inc* | 1,88 % | 26.10.2029 | 381.998 | 0,58 |
| 100.000 | Vonovia SE* | 0,25 % | 01.09.2028 | 94.018 | 0,14 |
| 100.000 | Vonovia SE* | 1,00 % | 16.06.2033 | 84.261 | 0,13 |
| 137.000 | WEPA Hygieneprodukte GmbH** | 2,88 % | 15.12.2027 | 142.079 | 0,22 |
| 100.000 | Westlake Corp* | 1,63 % | 17.07.2029 | 99.416 | 0,15 |
| 100.000 | WMG Acquisition Corp* | 2,25 % | 15.08.2031 | 97.205 | 0,15 |

Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 41,91 % (31. Dezember 2022: 46,55 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Euro (Fortsetzung) | | | | | |
| 100.000 | ZF Finance GmbH* | 3,75 % | 21.09.2028 | 106.842 | 0,16 |
| 100.000 | Ziggo Bond Co BV* | 3,38 % | 28.02.2030 | 93.579 | 0,14 |
| Euro insgesamt | | | | 17.426.821 | 26,65 |
| Britisches Pfund | | | | | |
| 135.000 | AA Bond Co Ltd* | 6,50 % | 31.01.2026 | 164.418 | 0,25 |
| 100.000 | Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc* | 4,75 % | 15.07.2027 | 93.013 | 0,14 |
| 100.000 | B&M European Value Retail SA* | 8,13 % | 15.11.2030 | 136.069 | 0,21 |
| 150.000 | Barclays Plc* | 7,09 % | 06.11.2029 | 203.862 | 0,31 |
| 100.000 | Bellis Acquisition Co Plc** | 3,25 % | 16.02.2026 | 118.650 | 0,18 |
| 100.000 | British Telecommunications Plc* | 8,38 % | 20.12.2083 | 134.933 | 0,21 |
| 100.000 | Centrica Plc* | 5,25 % | 10.04.2075 | 126.209 | 0,19 |
| 100.000 | Co-operative Group Holdings 2011 Ltd* | 7,50 % | 08.07.2026 | 126.115 | 0,19 |
| 100.000 | Coventry Building Society* | 7,00 % | 07.11.2027 | 132.839 | 0,20 |
| 112.000 | CPUK Finance Ltd** | 6,50 % | 28.08.2026 | 138.473 | 0,21 |
| 160.000 | Lloyds Banking Group Plc* | 2,71 % | 03.12.2035 | 164.651 | 0,25 |
| 120.000 | Mobico Group Plc* | 4,25 % | 29.12.2049 | 135.464 | 0,21 |
| 600.000 | NGG Finance Plc* | 5,63 % | 18.06.2073 | 756.133 | 1,16 |
| 200.000 | Pension Insurance Corp Plc* | 8,00 % | 13.11.2033 | 273.623 | 0,42 |
| 100.000 | Pinewood Finance Co Ltd** | 3,25 % | 30.09.2025 | 124.222 | 0,19 |
| 100.000 | Pinnacle Bidco Plc* | 10,00 % | 11.10.2028 | 132.819 | 0,20 |
| 100.000 | RAC Bond Co Plc** | 5,25 % | 04.11.2027 | 111.898 | 0,17 |
| 100.000 | Travis Perkins Plc* | 3,75 % | 17.02.2026 | 120.596 | 0,19 |
| 100.000 | TVL Finance Plc** | 10,25 % | 28.04.2028 | 132.824 | 0,20 |
| 150.000 | Virgin Media Secured Finance Plc* | 4,25 % | 15.01.2030 | 167.874 | 0,26 |
| 100.000 | Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC** | 4,88 % | 15.07.2028 | 117.653 | 0,18 |
| 100.000 | Vodafone Group Plc* | 5,90 % | 26.11.2032 | 140.056 | 0,21 |
| 300.000 | Volkswagen Financial Services NV* | 4,25 % | 09.10.2025 | 376.830 | 0,58 |
| 100.000 | Volkswagen Financial Services NV* | 6,50 % | 18.09.2027 | 133.353 | 0,20 |
| 172.000 | Westfield America Management Ltd* | 2,63 % | 30.03.2029 | 189.862 | 0,29 |
| Britisches Pfund insgesamt | | | | 4.452.439 | 6,80 |
| US-Dollar | | | | | |
| 20.000 | AbbVie Inc* | 4,88 % | 14.11.2048 | 19.527 | 0,03 |
| 200.000 | Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC* | 4,60 % | 02.11.2047 | 184.066 | 0,28 |
| 70.000 | Air Lease Corp* | 0,70 % | 15.02.2024 | 69.571 | 0,11 |
| 90.000 | Air Lease Corp* | 2,30 % | 01.02.2025 | 86.897 | 0,13 |
| 40.000 | Amgen Inc** | 5,75 % | 02.03.2063 | 42.016 | 0,07 |
| 45.000 | Apple Inc** | 4,65 % | 23.02.2046 | 44.444 | 0,07 |
| 80.000 | AT&T Inc* | 3,65 % | 01.06.2051 | 60.312 | 0,09 |

Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 41,91 % (31. Dezember 2022: 46,55 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 60.000 | Bank of America Corp** | 2,50 % | 13.02.2031 | 51.555 | 0,08 |
| 125.000 | Bank of America Corp** | 2,97 % | 04.02.2033 | 106.403 | 0,16 |
| 110.000 | Bank of America Corp** | 3,71 % | 24.04.2028 | 105.114 | 0,16 |
| 145.000 | Barclays Plc* | 2,85 % | 07.05.2026 | 139.862 | 0,21 |
| 100.000 | Boeing Co* | 5,81 % | 01.05.2050 | 103.625 | 0,16 |
| 100.000 | Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais** | 5,33 % | 15.02.2028 | 98.533 | 0,15 |
| 130.000 | Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital** | 4,80 % | 01.03.2050 | 100.796 | 0,15 |
| 15.000 | Cigna Corp* | 3,20 % | 15.03.2040 | 11.737 | 0,02 |
| 70.000 | Citigroup Inc** | 2,98 % | 05.11.2030 | 62.380 | 0,10 |
| 95.000 | Citigroup Inc** | 3,35 % | 24.04.2025 | 94.294 | 0,14 |
| 105.000 | Citigroup Inc** | 3,52 % | 27.10.2028 | 99.372 | 0,15 |
| 125.000 | Citigroup Inc** | 3,79 % | 17.03.2033 | 112.469 | 0,17 |
| 165.000 | Comcast Corp** | 2,94 % | 01.11.2056 | 108.621 | 0,17 |
| 35.000 | Corebridge Financial Inc** | 4,35 % | 05.04.2042 | 29.735 | 0,05 |
| 30.000 | CVS Health Corp* | 4,13 % | 01.04.2040 | 25.791 | 0,04 |
| 135.000 | CVS Health Corp* | 5,05 % | 25.03.2048 | 126.383 | 0,19 |
| 80.000 | Discovery Communications LLC** | 3,63 % | 15.05.2030 | 72.548 | 0,11 |
| 84.000 | DTE Energy Co* | 3,40 % | 15.06.2029 | 78.586 | 0,12 |
| 55.000 | Duke Energy Corp* | 2,55 % | 15.06.2031 | 46.968 | 0,07 |
| 200.000 | Empresa de los Ferrocarriles del Estado* | 3,83 % | 14.09.2061 | 137.585 | 0,21 |
| 140.000 | EPR Properties** | 3,60 % | 15.11.2031 | 116.244 | 0,18 |
| 90.000 | Exxon Mobil Corp* | 3,45 % | 15.04.2051 | 70.692 | 0,11 |
| 130.000 | Goldman Sachs Group Inc** | 2,62 % | 22.04.2032 | 109.168 | 0,17 |
| 45.000 | Goldman Sachs Group Inc** | 3,27 % | 29.09.2025 | 44.244 | 0,07 |
| 85.000 | Goldman Sachs Group Inc** | 3,69 % | 05.06.2028 | 81.252 | 0,12 |
| 105.000 | Goldman Sachs Group Inc** | 3,81 % | 23.04.2029 | 99.748 | 0,15 |
| 95.000 | Goldman Sachs Group Inc** | 4,02 % | 31.10.2038 | 82.958 | 0,13 |
| 80.000 | HCA Inc* | 5,25 % | 15.06.2049 | 74.469 | 0,11 |
| 60.000 | JPMorgan Chase & Co** | 2,96 % | 13.05.2031 | 52.753 | 0,08 |
| 50.000 | JPMorgan Chase & Co** | 3,11 % | 22.04.2041 | 38.531 | 0,06 |
| 200.000 | KazMunayGas National Co JSC* | 5,38 % | 24.04.2030 | 198.766 | 0,30 |
| 15.000 | L3Harris Technologies Inc* | 5,40 % | 15.01.2027 | 15.319 | 0,02 |
| 25.000 | L3Harris Technologies Inc* | 5,40 % | 31.07.2033 | 26.005 | 0,04 |
| 25.000 | L3Harris Technologies Inc* | 5,60 % | 31.07.2053 | 26.644 | 0,04 |
| 240.000 | Lloyds Banking Group Plc* | 3,51 % | 18.03.2026 | 234.508 | 0,36 |
| 55.000 | Marathon Petroleum Corp** | 4,70 % | 01.05.2025 | 54.673 | 0,08 |
| 100.000 | Molson Coors Beverage Co* | 4,20 % | 15.07.2046 | 85.358 | 0,13 |
| 105.000 | Morgan Stanley** | 0,79 % | 22.01.2025 | 104.694 | 0,16 |
| 135.000 | Morgan Stanley** | 2,70 % | 22.01.2031 | 118.099 | 0,18 |
| 60.000 | Morgan Stanley* | 3,63 % | 20.01.2027 | 58.203 | 0,09 |

Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 41,91 % (31. Dezember 2022: 46,55 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 55.000 | Morgan Stanley** | 5,25 % | 21.04.2034 | 55.020 | 0,08 |
| 30.000 | Morgan Stanley** | 5,95 % | 19.01.2038 | 30.352 | 0,05 |
| 60.000 | MPLX LP* | 4,70 % | 15.04.2048 | 51.843 | 0,08 |
| 95.000 | Oracle Corp* | 4,00 % | 15.07.2046 | 76.315 | 0,12 |
| 55.000 | Oracle Corp* | 5,55 % | 06.02.2053 | 55.079 | 0,08 |
| 1.360.000 | Petroleos de Venezuela SA* | 5,38 % | 12.04.2027 | 151.640 | 0,23 |
| 200.000 | Petroleos del Peru SA* | 5,63 % | 19.06.2047 | 123.395 | 0,19 |
| 109.000 | Petroleos Mexicanos** | 7,69 % | 23.01.2050 | 77.655 | 0,12 |
| 35.000 | Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd* | 5,34 % | 19.05.2063 | 35.365 | 0,05 |
| 55.000 | Rogers Communications Inc** | 3,80 % | 15.03.2032 | 50.630 | 0,08 |
| 115.000 | Synchrony Financial* | 2,88 % | 28.10.2031 | 92.207 | 0,14 |
| 83.000 | Sysco Corp* | 6,60 % | 01.04.2050 | 97.544 | 0,15 |
| 95.000 | T-Mobile USA Inc** | 4,50 % | 15.04.2050 | 84.026 | 0,13 |
| 15.000 | Travelers Cos Inc* | 5,45 % | 25.05.2053 | 16.201 | 0,03 |
| 120.000 | Truist Financial Corp** | 5,87 % | 08.06.2034 | 122.495 | 0,19 |
| 200.000 | Vedanta Resources Finance II Plc* | 8,95 % | 11.03.2025 | 148.908 | 0,23 |
| 235.000 | Verizon Communications Inc* | 2,55 % | 21.03.2031 | 202.694 | 0,31 |
| 80.000 | Vodafone Group Plc** | 4,88 % | 19.06.2049 | 72.603 | 0,11 |
| 90.000 | Warnermedia Holdings Inc** | 5,14 % | 15.03.2052 | 77.305 | 0,12 |
| US-Dollar insgesamt | | | | 5.532.795 | 8,46 |
| Unternehmensanleihen insgesamt | | | | 27.412.055 | 41,91 |
| Staatsanleihen 32,31 % (31. Dezember 2022: 32,47 %) | | | | | |
| Australischer Dollar | | | | | |
| 285.000 | New South Wales Treasury Corp* | 4,25 % | 20.02.2036 | 185.386 | 0,28 |
| 350.000 | New Zealand Local Government Funding Agency Bond** | 5,10 % | 28.11.2030 | 246.465 | 0,38 |
| 310.000 | Queensland Treasury Corp* | 4,50 % | 09.03.2033 | 213.011 | 0,32 |
| 226.000 | Queensland Treasury Corp* | 5,25 % | 21.07.2036 | 161.892 | 0,25 |
| Australischer Dollar insgesamt | | | | 806.754 | 1,23 |
| Chinesischer Yuan Renminbi | | | | | |
| 7.850.000 | China Government Bond** | 2,62 % | 25.06.2030 | 1.112.780 | 1,70 |
| 5.980.000 | China Government Bond** | 2,88 % | 25.02.2033 | 864.016 | 1,32 |
| Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt | | | | 1.976.796 | 3,02 |
| Tschechische Krone | | | | | |
| 10.460.000 | Czech Republic Government Bond* | 4,90 % | 14.04.2034 | 514.023 | 0,79 |
| Tschechische Krone insgesamt | | | | 514.023 | 0,79 |

Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 32,31 % (31. Dezember 2022: 32,47 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Euro | | | | | |
| 100.000 | Andorra International Bond* | 1,25 % | 23.02.2027 | 103.386 | 0,16 |
| 83.677 | Bundesobligation* | 2,20 % | 13.04.2028 | 93.322 | 0,14 |
| 80.000 | Bundesobligation* | 2,40 % | 19.10.2028 | 90.186 | 0,14 |
| 28.767 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe* | 0,00 % | 15.08.2030 | 28.125 | 0,04 |
| 34.595 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe* | 0,00 % | 15.02.2031 | 33.439 | 0,05 |
| 40.582 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe* | 0,00 % | 15.08.2031 | 38.818 | 0,06 |
| 31.500 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe* | 0,00 % | 15.08.2052 | 18.564 | 0,03 |
| 162.529 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe* | 0,50 % | 15.02.2026 | 172.948 | 0,26 |
| 338.395 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe* | 1,70 % | 15.08.2032 | 366.206 | 0,56 |
| 100.000 | Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale* | 1,50 % | 25.05.2032 | 101.237 | 0,15 |
| 140.000 | Egypt Government International Bond* | 6,38 % | 11.04.2031 | 99.686 | 0,15 |
| 83.000 | European Union* | 0,00 % | 06.07.2026 | 86.223 | 0,13 |
| 72.590 | European Union* | 1,63 % | 04.12.2029 | 76.550 | 0,12 |
| 68.000 | European Union* | 2,00 % | 04.10.2027 | 74.016 | 0,11 |
| 32.000 | European Union* | 2,75 % | 04.12.2037 | 34.721 | 0,05 |
| 44.800 | European Union* | 3,38 % | 04.10.2038 | 52.023 | 0,08 |
| 44.000 | European Union* | 3,25 % | 04.07.2034 | 50.980 | 0,08 |
| 113.305 | French Republic Government Bond OAT** | 0,25 % | 25.07.2024 | 124.322 | 0,19 |
| 20.000 | French Republic Government Bond OAT* | 0,75 % | 25.02.2028 | 20.822 | 0,03 |
| 7.341 | French Republic Government Bond OAT* | 0,75 % | 25.05.2052 | 4.654 | 0,01 |
| 266.000 | French Republic Government Bond OAT* | 0,75 % | 25.05.2053 | 165.106 | 0,25 |
| 43.355 | French Republic Government Bond OAT* | 1,50 % | 25.05.2031 | 45.230 | 0,07 |
| 12.000 | French Republic Government Bond OAT* | 1,75 % | 25.05.2066 | 9.495 | 0,01 |
| 4.000 | Hungary Government International Bond* | 1,75 % | 05.06.2035 | 3.403 | 0,01 |
| 200.000 | Indonesia Government International Bond* | 1,40 % | 30.10.2031 | 187.862 | 0,29 |
| 21.000 | Ireland Government Bond** | 0,20 % | 18.10.2030 | 20.206 | 0,03 |
| 35.000 | Ireland Government Bond* | 0,55 % | 22.04.2041 | 27.123 | 0,04 |
| 23.000 | Ireland Government Bond* | 2,40 % | 15.05.2030 | 25.686 | 0,04 |
| 8.400 | Ireland Government Bond* | 3,00 % | 18.10.2043 | 9.658 | 0,01 |
| 18.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | 0,00 % | 01.08.2026 | 18.527 | 0,03 |
| 32.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | 0,50 % | 15.07.2028 | 31.744 | 0,05 |
| 263.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro* | 0,90 % | 01.04.2031 | 245.886 | 0,38 |
| 64.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro* | 0,95 % | 15.09.2027 | 66.111 | 0,10 |
| 20.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | 0,95 % | 01.06.2032 | 18.106 | 0,03 |
| 31.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | 1,20 % | 15.08.2025 | 33.306 | 0,05 |
| 18.989 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | 1,40 % | 26.05.2025 | 20.646 | 0,03 |
| 39.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | 1,60 % | 01.06.2026 | 41.919 | 0,06 |
| 299.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | 1,75 % | 30.05.2024 | 327.570 | 0,50 |
| 11.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | 1,85 % | 01.07.2025 | 11.948 | 0,02 |
| 19.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | 2,05 % | 01.08.2027 | 20.454 | 0,03 |

Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 32,31 % (31. Dezember 2022: 32,47 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Euro (Fortsetzung) | | | | | |
| 118.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro* | 3,40 % | 28.03.2025 | 130.748 | 0,20 |
| 49.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro* | 4,35 % | 01.11.2033 | 57.344 | 0,09 |
| 130.000 | Ivory Coast Government International Bond* | 5,25 % | 22.03.2030 | 129.260 | 0,20 |
| 110.000 | Ivory Coast Government International Bond* | 5,88 % | 17.10.2031 | 109.275 | 0,17 |
| 23.128 | Kingdom of Belgium Government Bond* | 0,40 % | 22.06.2040 | 17.052 | 0,03 |
| 21.000 | Kingdom of Belgium Government Bond* | 3,00 % | 22.06.2033 | 24.145 | 0,04 |
| 27.000 | Kingdom of Belgium Government Bond* | 3,30 % | 22.06.2054 | 30.435 | 0,05 |
| 18.000 | Kingdom of Belgium Government Bond* | 3,75 % | 22.06.2045 | 22.009 | 0,03 |
| 100.000 | Magyar Export-Import Bank Zrt* | 6,00 % | 16.05.2029 | 117.490 | 0,18 |
| 100.000 | Philippine Government International Bond* | 1,75 % | 28.04.2041 | 77.498 | 0,12 |
| 531.000 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT* | 1,65 % | 16.07.2032 | 543.313 | 0,83 |
| 217.000 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT* | 2,88 % | 15.10.2025 | 241.461 | 0,37 |
| 35.000 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT** | 2,88 % | 21.07.2026 | 39.348 | 0,06 |
| 30.000 | Republic of Poland Government International Bond* | 3,88 % | 14.02.2033 | 34.650 | 0,05 |
| 26.000 | Romanian Government International Bond* | 1,75 % | 13.07.2030 | 23.281 | 0,04 |
| 123.000 | Romanian Government International Bond* | 2,00 % | 28.01.2032 | 105.509 | 0,16 |
| 15.000 | Romanian Government International Bond* | 3,62 % | 26.05.2030 | 15.273 | 0,02 |
| 32.000 | Romanian Government International Bond* | 3,62 % | 26.05.2030 | 32.583 | 0,05 |
| 37.000 | Romanian Government International Bond* | 3,75 % | 07.02.2034 | 35.343 | 0,05 |
| 90.000 | Romanian Government International Bond* | 3,88 % | 29.10.2035 | 85.038 | 0,13 |
| 23.000 | Romanian Government International Bond* | 4,13 % | 11.03.2039 | 21.250 | 0,03 |
| 30.000 | Romanian Government International Bond* | 6,38 % | 18.09.2033 | 35.112 | 0,05 |
| 47.000 | Romanian Government International Bond* | 6,63 % | 27.09.2029 | 55.638 | 0,09 |
| 100.000 | Serbia International Bond* | 2,05 % | 23.09.2036 | 77.148 | 0,12 |
| 18.300 | Slovakia Government Bond* | 0,38 % | 21.04.2036 | 14.009 | 0,02 |
| 31.000 | Slovenia Government Bond* | 1,50 % | 25.03.2035 | 29.009 | 0,04 |
| 20.000 | Slovenia Government Bond* | 3,63 % | 11.03.2033 | 23.394 | 0,04 |
| 37.000 | Spain Government Bond* | 1,30 % | 31.10.2026 | 39.513 | 0,06 |
| 14.000 | Spain Government Bond* | 1,40 % | 30.04.2028 | 14.762 | 0,02 |
| 24.000 | Spain Government Bond* | 1,85 % | 30.07.2035 | 23.340 | 0,04 |
| 35.000 | Spain Government Bond* | 3,15 % | 30.04.2033 | 39.349 | 0,06 |
| 18.000 | Spain Government Bond* | 3,55 % | 31.10.2033 | 20.836 | 0,03 |
| 80.000 | Spain Government Bond* | 3,55 % | 31.10.2033 | 92.604 | 0,14 |
| 70.000 | State of North Rhine-Westphalia Germany* | 1,45 % | 16.02.2043 | 59.843 | 0,09 |
| 12.000 | State of North Rhine-Westphalia Germany* | 1,65 % | 22.02.2038 | 11.412 | 0,02 |
| Euro insgesamt | | | | 5.428.488 | 8,29 |
| Ungarischer Forint | | | | | |
| 108.060.000 | Hungary Government Bond* | 4,75 % | 24.11.2032 | 288.139 | 0,44 |
| Ungarischer Forint insgesamt | | | | 288.139 | 0,44 |

Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 32,31 % (31. Dezember 2022: 32,47 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Indonesische Rupiah | | | | | |
| 5.237.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 6,38 % | 15.04.2032 | 335.493 | 0,51 |
| 18.973.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 7,00 % | 15.02.2033 | 1.278.111 | 1,96 |
| Indonesische Rupiah insgesamt | | | | 1.613.604 | 2,47 |
| Mexikanischer Peso | | | | | |
| 29.200.000 | Mexican Bonos* | 7,50 % | 26.05.2033 | 1.574.217 | 2,41 |
| 23.900.000 | Mexican Bonos* | 7,75 % | 29.05.2031 | 1.317.213 | 2,01 |
| Mexikanischer Peso insgesamt | | | | 2.891.430 | 4,42 |
| Neuseeländischer Dollar | | | | | |
| 5.143.000 | New Zealand Government Bond* | 3,50 % | 14.04.2033 | 3.053.390 | 4,67 |
| Neuseeländischer Dollar insgesamt | | | | 3.053.390 | 4,67 |
| Polnischer Zloty | | | | | |
| 2.426.000 | Republic of Poland Government Bond* | 6,00 % | 25.10.2033 | 654.745 | 1,00 |
| 1.164.000 | Republic of Poland Government Bond* | 7,50 % | 25.07.2028 | 325.964 | 0,50 |
| Polnischer Zloty insgesamt | | | | 980.709 | 1,50 |
| Britisches Pfund | | | | | |
| 612.000 | United Kingdom Gilt* | 1,25 % | 31.07.2051 | 413.338 | 0,63 |
| Britisches Pfund insgesamt | | | | 413.338 | 0,63 |
| Südkoreanischer Won | | | | | |
| 308.330.000 | Korea Treasury Bond* | 4,25 % | 10.12.2032 | 258.205 | 0,40 |
| Südkoreanischer Won insgesamt | | | | 258.205 | 0,40 |
| Thailändischer Baht | | | | | |
| 9.569.000 | Thailand Government Bond** | 2,00 % | 17.12.2031 | 267.740 | 0,41 |
| Thailändischer Baht insgesamt | | | | 267.740 | 0,41 |
| US-Dollar | | | | | |
| 200.000 | Angolan Government International Bond* | 8,75 % | 14.04.2032 | 176.445 | 0,27 |
| 100.000 | Argentine Republic Government International Bond* | 0,75 % | 09.07.2030 | 40.351 | 0,06 |
| 30.000 | Argentine Republic Government International Bond* | 1,00 % | 09.07.2029 | 12.060 | 0,02 |
| 260.000 | Argentine Republic Government International Bond* | 3,63 % | 09.07.2035 | 89.847 | 0,14 |
| 200.000 | Colombia Government International Bond* | 6,13 % | 18.01.2041 | 182.448 | 0,28 |
| 160.000 | Dominican Republic International Bond* | 4,88 % | 23.09.2032 | 146.096 | 0,22 |
| 14.629 | Ecuador Government International Bond* | 0,00 % | 31.07.2030 | 4.209 | 0,01 |
| 3.972 | Ecuador Government International Bond* | 2,50 % | 31.07.2040 | 1.271 | 0,00 |

Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 32,31 % (31. Dezember 2022: 32,47 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 153.501 | Ecuador Government International Bond* | 3,50 % | 31.07.2035 | 55.312 | 0,09 |
| 30.932 | Ecuador Government International Bond* | 6,00 % | 31.07.2030 | 14.455 | 0,02 |
| 227.000 | El Salvador Government International Bond* | 7,65 % | 15.06.2035 | 177.911 | 0,27 |
| 200.000 | Ghana Government International Bond* | 7,63 % | 16.05.2029 | 87.711 | 0,13 |
| 112.000 | Lebanon Government International Bond* | 6,38 % | 09.03.2020 | 6.860 | 0,01 |
| 220.000 | Lebanon Government International Bond* | 6,60 % | 27.11.2026 | 13.533 | 0,02 |
| 108.000 | Lebanon Government International Bond* | 6,65 % | 26.02.2030 | 6.767 | 0,01 |
| 62.000 | Lebanon Government International Bond* | 8,25 % | 17.05.2034 | 3.861 | 0,01 |
| 80.000 | Mexico Government International Bond* | 5,75 % | 12.10.2110 | 71.894 | 0,11 |
| 200.000 | Nigeria Government International Bond* | 8,38 % | 24.03.2029 | 192.509 | 0,29 |
| 200.000 | Panama Government International Bond* | 2,25 % | 29.09.2032 | 146.320 | 0,22 |
| 200.000 | Republic of South Africa Government International Bond* | 7,30 % | 20.04.2052 | 189.981 | 0,29 |
| 200.000 | Sri Lanka Government International Bond* | 6,75 % | 18.04.2028 | 101.112 | 0,16 |
| 200.000 | Sri Lanka Government International Bond* | 7,85 % | 14.03.2029 | 101.016 | 0,15 |
| 150.000 | Ukraine Government International Bond* | 7,75 % | 01.09.2029 | 41.596 | 0,06 |
| 525.000 | United States Treasury Note/Bond* | 0,25 % | 15.06.2024 | 513.547 | 0,79 |
| 126.000 | United States Treasury Note/Bond* | 2,00 % | 15.08.2051 | 82.323 | 0,13 |
| 60.000 | United States Treasury Note/Bond* | 3,50 % | 15.02.2039 | 56.856 | 0,09 |
| 200.000 | Zambia Government International Bond* | 8,97 % | 30.07.2027 | 124.476 | 0,19 |
| US-Dollar insgesamt | | | | 2.640.767 | 4,04 |
| Staatsanleihen insgesamt | | | | 21.133.383 | 32,31 |
| Mortgage-Backed Securities 22,27 % (31. Dezember 2022: 13,74 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 224.126 | Fannie Mae Pool | 2,50 % | 01.09.2051 | 190.769 | 0,29 |
| 127.127 | Fannie Mae Pool | 2,50 % | 01.10.2051 | 108.413 | 0,17 |
| 308.131 | Fannie Mae Pool | 2,50 % | 01.01.2052 | 262.241 | 0,40 |
| 488.382 | Fannie Mae Pool | 2,50 % | 01.03.2052 | 415.896 | 0,64 |
| 197.718 | Fannie Mae Pool | 2,50 % | 01.04.2052 | 168.361 | 0,26 |
| 55.002 | Fannie Mae Pool | 3,00 % | 01.11.2045 | 50.256 | 0,08 |
| 46.434 | Fannie Mae Pool | 3,00 % | 01.08.2046 | 42.197 | 0,06 |
| 70.952 | Fannie Mae Pool | 3,00 % | 01.01.2050 | 63.531 | 0,10 |
| 86.745 | Fannie Mae Pool | 3,00 % | 01.03.2050 | 77.471 | 0,12 |
| 76.337 | Fannie Mae Pool | 3,00 % | 01.04.2050 | 68.176 | 0,10 |
| 46.597 | Fannie Mae Pool | 3,00 % | 01.07.2051 | 41.256 | 0,06 |
| 169.360 | Fannie Mae Pool | 3,00 % | 01.02.2052 | 149.958 | 0,23 |
| 36.962 | Fannie Mae Pool | 3,50 % | 01.03.2047 | 34.509 | 0,05 |
| 58.307 | Fannie Mae Pool | 3,50 % | 01.09.2047 | 54.438 | 0,08 |
| 69.459 | Fannie Mae Pool | 3,50 % | 01.02.2048 | 64.851 | 0,10 |
| 242.073 | Fannie Mae Pool | 3,50 % | 01.05.2052 | 223.008 | 0,34 |

Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|--------------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Mortgage-Backed Securities 22,27 % (31. Dezember 2022: 13,74 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 72.922 | Fannie Mae Pool | 4,00 % | 01.07.2048 | 70.224 | 0,11 |
| 22.124 | Fannie Mae Pool | 4,00 % | 01.10.2048 | 21.281 | 0,03 |
| 64.692 | Fannie Mae Pool | 4,00 % | 01.07.2049 | 62.098 | 0,09 |
| 183.155 | Fannie Mae Pool | 4,00 % | 01.04.2052 | 173.411 | 0,26 |
| 109.125 | Fannie Mae Pool | 4,00 % | 01.06.2052 | 103.266 | 0,16 |
| 118.347 | Fannie Mae Pool | 4,00 % | 01.07.2052 | 112.634 | 0,17 |
| 289.129 | Fannie Mae Pool | 4,00 % | 01.08.2052 | 273.605 | 0,42 |
| 332.161 | Fannie Mae Pool | 4,50 % | 01.09.2052 | 322.212 | 0,49 |
| 463.926 | Fannie Mae Pool | 4,50 % | 01.10.2052 | 450.031 | 0,69 |
| 590.124 | Fannie Mae Pool | 4,50 % | 01.01.2053 | 572.449 | 0,87 |
| 133.380 | Fannie Mae Pool | 5,00 % | 01.08.2052 | 132.179 | 0,20 |
| 69.854 | Fannie Mae Pool | 5,00 % | 01.11.2052 | 69.204 | 0,11 |
| 411.482 | Fannie Mae Pool | 5,00 % | 01.01.2053 | 407.724 | 0,62 |
| 228.373 | Fannie Mae Pool | 5,00 % | 01.04.2053 | 226.021 | 0,35 |
| 455.278 | Fannie Mae Pool | 5,50 % | 01.01.2053 | 457.435 | 0,70 |
| 282.508 | Fannie Mae Pool | 5,50 % | 01.02.2053 | 283.856 | 0,43 |
| 216.239 | Fannie Mae Pool | 5,50 % | 01.07.2053 | 217.504 | 0,33 |
| 308.825 | Fannie Mae Pool | 6,00 % | 01.07.2053 | 313.642 | 0,48 |
| 82.800 | Fannie Mae Pool | 6,00 % | 01.10.2053 | 84.226 | 0,13 |
| 72.827 | Fannie Mae Pool (BH9277) | 3,50 % | 01.02.2048 | 67.995 | 0,10 |
| 82.458 | Fannie Mae Pool (CB4020) | 4,00 % | 01.07.2052 | 78.009 | 0,12 |
| 78.501 | Fannie Mae Pool (MA4655) | 4,00 % | 01.07.2052 | 74.332 | 0,11 |
| 394.225 | Fannie Mae Pool (MA4700) | 4,00 % | 01.08.2052 | 373.037 | 0,57 |
| 183.723 | Freddie Mac Pool | 2,50 % | 01.12.2050 | 156.509 | 0,24 |
| 81.049 | Freddie Mac Pool | 2,50 % | 01.08.2051 | 69.104 | 0,11 |
| 199.052 | Freddie Mac Pool | 2,50 % | 01.09.2051 | 169.508 | 0,26 |
| 89.568 | Freddie Mac Pool | 2,50 % | 01.01.2052 | 76.268 | 0,12 |
| 289.170 | Freddie Mac Pool | 2,50 % | 01.02.2052 | 246.230 | 0,38 |
| 273.545 | Freddie Mac Pool | 2,50 % | 01.03.2052 | 233.018 | 0,36 |
| 300.337 | Freddie Mac Pool | 2,50 % | 01.04.2052 | 255.721 | 0,39 |
| 18.351 | Freddie Mac Pool | 3,00 % | 01.03.2050 | 16.542 | 0,03 |
| 99.378 | Freddie Mac Pool | 3,00 % | 01.07.2050 | 88.853 | 0,14 |
| 56.305 | Freddie Mac Pool | 3,00 % | 01.01.2052 | 50.255 | 0,08 |
| 49.312 | Freddie Mac Pool | 3,50 % | 01.04.2052 | 45.226 | 0,07 |
| 216.178 | Freddie Mac Pool | 3,50 % | 01.05.2052 | 198.367 | 0,30 |
| 342.188 | Freddie Mac Pool | 4,00 % | 01.09.2052 | 323.785 | 0,49 |
| 26.493 | Freddie Mac Pool | 4,50 % | 01.07.2052 | 25.700 | 0,04 |
| 570.368 | Freddie Mac Pool | 4,50 % | 01.08.2052 | 553.284 | 0,85 |
| 185.376 | Freddie Mac Pool | 5,00 % | 01.11.2052 | 183.706 | 0,28 |
| 146.375 | Freddie Mac Pool | 5,00 % | 01.01.2053 | 144.921 | 0,22 |

Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|-----------------------------------|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Mortgage-Backed Securities 22,27 % (31. Dezember 2022: 13,74 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 267.009 | Freddie Mac Pool | 5,00 % | 01.02.2053 | 264.259 | 0,40 |
| 258.254 | Freddie Mac Pool | 5,00 % | 01.04.2053 | 255.594 | 0,39 |
| 181.861 | Freddie Mac Pool | 5,50 % | 01.09.2052 | 183.207 | 0,28 |
| 195.306 | Freddie Mac Pool | 5,50 % | 01.10.2052 | 196.567 | 0,30 |
| 116.329 | Freddie Mac Pool | 5,50 % | 01.02.2053 | 116.965 | 0,18 |
| 259.842 | Freddie Mac Pool | 5,50 % | 01.05.2053 | 260.994 | 0,40 |
| 116.451 | Freddie Mac Pool | 6,00 % | 01.03.2053 | 118.310 | 0,18 |
| 323.313 | Freddie Mac Pool | 6,00 % | 01.04.2053 | 328.406 | 0,50 |
| 499.569 | Freddie Mac Pool | 6,00 % | 01.05.2053 | 507.579 | 0,78 |
| 384.926 | Freddie Mac Pool | 6,00 % | 01.06.2053 | 390.991 | 0,60 |
| 77.976 | Freddie Mac Pool | 6,00 % | 01.09.2053 | 79.421 | 0,12 |
| 203.740 | Freddie Mac Pool (QE2363) | 3,50 % | 01.05.2052 | 186.881 | 0,29 |
| 239.931 | Freddie Mac Pool (RA7384) | 3,50 % | 01.05.2052 | 220.083 | 0,34 |
| 350.000 | Ginnie Mae | 5,00 % | 01.01.2054 | 347.594 | 0,53 |
| 495.000 | Ginnie Mae | 5,50 % | 01.01.2054 | 498.636 | 0,76 |
| 187.474 | Ginnie Mae II Pool | 2,50 % | 20.05.2052 | 163.972 | 0,25 |
| 140.856 | Ginnie Mae II Pool | 4,50 % | 20.09.2052 | 137.548 | 0,21 |
| 155.074 | Ginnie Mae II Pool | 5,00 % | 20.03.2053 | 154.114 | 0,24 |
| 34.627 | Ginnie Mae II Pool | 5,00 % | 20.07.2053 | 34.381 | 0,05 |
| 154.132 | Ginnie Mae II Pool | 5,50 % | 20.03.2053 | 155.326 | 0,24 |
| 163.448 | Ginnie Mae II Pool | 6,00 % | 20.08.2053 | 166.271 | 0,25 |
| Mortgage-Backed Securities insgesamt ** | | | | 14.565.802 | 22,27 |
| | | | | | |
| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | | | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Investmentfonds 0,03 % (31. Dezember 2022: 2,37 %) | | | | | |
| Britisches Pfund | | | | | |
| 23.786 | NB Global Monthly Income Fund Ltd | | | 21.165 | 0,03 |
| Investmentfonds insgesamt # | | | | 21.165 | 0,03 |
| Anlagen insgesamt | | | | 64.950.148 | 99,30 |

Devisenterminkontrakte 7,14 % (31. Dezember 2022: 2,72 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeits- datum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettover- mögens |
|-----------------------|------------------------|-----------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| 2.145.436 AUD | 1.370.700 US\$ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 1 | 94.001 | 0,14 |
| 7.990.660 AUD | 5.104.895 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 6 | 350.371 | 0,54 |
| 220.000 AUD | 144.454 US\$ | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 1 | 5.741 | 0,01 |
| 4.358.213 AUD | 2.810.182 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 5 | 165.192 | 0,25 |

Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 7,14 % (31. Dezember 2022: 2,72 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 452.490 AUD | 294.254 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | 14.663 | 0,02 |
| 5.491.940 AUD | 3.494.505 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | 254.872 | 0,39 |
| 5.661.591 BRL | 1.108.457 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | 55.788 | 0,09 |
| 1.784.234 CAD | 1.295.991 US\$ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 2 | 57.444 | 0,09 |
| 5.082.746 CAD | 3.712.059 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 4 | 143.471 | 0,22 |
| 458.979 CAD | 341.728 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 6.431 | 0,01 |
| 2.201.907 CAD | 1.600.103 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 4 | 70.159 | 0,11 |
| 433.481 CAD | 319.760 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 9.058 | 0,01 |
| 2.286.909 CHF | 2.558.950 US\$ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 3 | 162.657 | 0,25 |
| 2.027.231 CHF | 2.278.924 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | 133.644 | 0,20 |
| 592.616 CHF | 666.910 US\$ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 38.351 | 0,06 |
| 606.436 CHF | 679.341 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 2 | 42.367 | 0,06 |
| 1.709.480 CHF | 1.956.328 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | 78.092 | 0,12 |
| 139.401 CHF | 156.416 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 9.483 | 0,01 |
| 296.144.461 CLP | 319.070 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 19.785 | 0,03 |
| 581.556.016 CLP | 622.651 US\$ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 42.777 | 0,07 |
| 15.284.327 CNY | 2.103.404 US\$ | 18.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 45.426 | 0,07 |
| 5.242 CNY | 721 US\$ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 16 | 0,00 |
| 1.264.984 CNY | 178.169 US\$ | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 1 | 528 | 0,00 |
| 14.848.597 CZK | 639.008 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | 25.035 | 0,04 |
| 7.412.140 CZK | 328.078 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | 3.399 | 0,01 |
| 7.230.274 € | 7.710.490 US\$ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 8 | 281.403 | 0,43 |
| 200.000 € | 220.419 US\$ | 18.01.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | 648 | 0,00 |
| 4.203.304 € | 4.518.012 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 8 | 128.057 | 0,20 |
| 43.822 € | 47.008 US\$ | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 1 | 1.431 | 0,00 |
| 532.290 € | 565.741 US\$ | 18.01.2024 | Société Générale | 1 | 22.619 | 0,03 |
| 895.425 € | 962.375 US\$ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 3 | 27.372 | 0,04 |
| 4.273.094 € | 4.555.707 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 2 | 167.504 | 0,26 |
| 1.804.821 € | 1.965.592 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | 29.345 | 0,05 |
| 460.752 € | 490.601 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 4 | 18.685 | 0,03 |
| 1.576.689 £ | 1.928.962 US\$ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 3 | 81.178 | 0,12 |
| 114.648 £ | 142.994 US\$ | 18.01.2024 | Deutsche Bank AG | 2 | 3.172 | 0,01 |
| 1.869.817 £ | 2.292.014 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | 91.838 | 0,14 |
| 300.000 £ | 379.884 US\$ | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 1 | 2.590 | 0,00 |
| 266.136 £ | 328.329 US\$ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 10.971 | 0,02 |
| 40.000 £ | 45.696 € | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 487 | 0,00 |
| 673.299 £ | 834.443 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 2 | 23.954 | 0,04 |
| 1.397.783 £ | 1.739.681 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 3 | 42.369 | 0,07 |
| 15.000.000 HUF | 42.848 US\$ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 1 | 407 | 0,00 |
| 176.136.407 HUF | 487.327 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | 20.596 | 0,03 |

Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 7,14 % (31. Dezember 2022: 2,72 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 58.285.727 HUF | 156.943 US\$ | 18.01.2024 | Société Générale | 1 | 11.135 | 0,02 |
| 115.943.232 HUF | 328.803 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | 5.541 | 0,01 |
| 4.844.779 IDR | 307 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | 7 | 0,00 |
| 141.441.607 ¥ | 964.920 US\$ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 2 | 40.773 | 0,06 |
| 423.870.733 ¥ | 2.855.502 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 158.351 | 0,24 |
| 6.596.939 ¥ | 45.195 US\$ | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 1 | 1.711 | 0,00 |
| 371.424.510 ¥ | 2.534.326 US\$ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 2 | 106.618 | 0,16 |
| 93.862.694 ¥ | 664.761 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 2.632 | 0,00 |
| 146.969.225 ¥ | 985.946 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 59.050 | 0,09 |
| 564.067.131 KRW | 423.442 US\$ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 2 | 11.814 | 0,02 |
| 3.528.943 MXN | 190.767 US\$ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 1 | 17.079 | 0,03 |
| 1.500.000 MXN | 86.001 US\$ | 18.01.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | 2.346 | 0,00 |
| 35.626.106 MXN | 1.937.255 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | 161.035 | 0,25 |
| 11.415.118 MXN | 644.740 US\$ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 27.583 | 0,04 |
| 12.157.863 NOK | 1.123.341 US\$ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 4 | 74.289 | 0,11 |
| 3.481.628 NOK | 322.862 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 20.101 | 0,03 |
| 5.407.021 NOK | 489.906 US\$ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 42.721 | 0,07 |
| 3.836.976 NOK | 342.654 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 35.313 | 0,05 |
| 31.114.421 NOK | 2.846.513 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 4 | 218.463 | 0,33 |
| 544.667 NZD | 328.047 US\$ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 1 | 16.829 | 0,03 |
| 100.000 NZD | 61.170 US\$ | 18.01.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | 2.149 | 0,00 |
| 3.834.329 NZD | 2.250.210 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 4 | 177.644 | 0,27 |
| 3.841.342 NZD | 2.246.423 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 5 | 185.872 | 0,28 |
| 2.383.799 NZD | 1.421.445 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 4 | 87.949 | 0,13 |
| 2.736.454 PLN | 665.255 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | 30.501 | 0,05 |
| 500.000 PLN | 123.939 US\$ | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 1 | 3.188 | 0,01 |
| 1.350.517 PLN | 325.136 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 18.239 | 0,03 |
| 4.000.489 PLN | 958.662 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 3 | 58.480 | 0,09 |
| 19.224.962 SEK | 1.756.700 US\$ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 4 | 152.161 | 0,23 |
| 12.722.883 SEK | 1.164.015 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 4 | 99.250 | 0,15 |
| 6.337.484 SEK | 584.423 US\$ | 18.01.2024 | Société Générale | 2 | 44.831 | 0,07 |
| 7.917.996 SEK | 774.110 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 12.074 | 0,02 |
| 41.653 US\$ | 65.685 NZD | 18.01.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | 62 | 0,00 |
| 40.733 US\$ | 52.350.320 KRW | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 1 | 338 | 0,00 |
| 39.678 US\$ | 886.840 CZK | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 18 | 0,00 |
| 829.437 ZAR | 42.999 US\$ | 18.01.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | 2.296 | 0,00 |
| 49.498 ZAR | 2.564 US\$ | 18.01.2024 | Société Générale | 1 | 139 | 0,00 |

Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 7,14 % (31. Dezember 2022: 2,72 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 366 € | 397 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 4 | 8 | 0,00 |
| 144 € | 152 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 7 | 0,00 |
| 457 € | 493 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 4 | 13 | 0,00 |
| 14.253 € | 15.192 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 6 | 562 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 469 £ | 581 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 4 | 16 | 0,00 |
| 10.529 £ | 12.933 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 490 | 0,00 |
| 10.840 £ | 13.308 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 3 | 513 | 0,00 |
| 1.285 £ | 1.597 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 7 | 41 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ^{oo} | | | | | 4.673.609 | 7,14 |

Futures-Kontrakte 1,28 % (31. Dezember 2022: 0,75 %)

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---|--------------------------------|----------------------|
| 46 | 10-Year Mini Japanese Government Bond Future March 2024 | 41.105 | 0,06 |
| 3 | Australian Government Bond 10-Year Future March 2024 | 2.452 | 0,00 |
| 19 | Canadian 10-Year Bond Future March 2024 | 86.455 | 0,13 |
| 5 | Canadian 5-Year Bond Future March 2024 | 11.490 | 0,02 |
| 22 | Euro-Bund Future March 2024 | 94.293 | 0,14 |
| 2 | Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2024 | 23.949 | 0,04 |
| 43 | Euro-Schatz Future March 2024 | 30.279 | 0,05 |
| 7 | United Kingdom Long Gilt Future March 2024 | 57.646 | 0,09 |
| 25 | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2024 | 92.828 | 0,14 |
| 39 | US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2024 | 70.296 | 0,11 |
| 75 | US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2024 | 171.814 | 0,26 |
| 9 | US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2024 | 90.492 | 0,14 |
| 9 | US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2024 | 65.945 | 0,10 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten * | | 839.044 | 1,28 |

Zinsswap-Kontrakte 0,00 % (31. Dezember 2022: 0,02 %)

| Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei | Erhalt/(Zahlung) [#] | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|------------|-------------------------------|-------------------------------|-----------------|--------------------|--------------------------------|----------------------|
| CNY 16.892.000 | 17.08.2026 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 2,05 % | 7D CNRR | 76 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten ^{oo} | | | | | | 76 | 0,00 |

[#]Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

¹Zentral abgewickelter Swap.

Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Credit-Default-Swap-Kontrakten 0,30 % (31. Dezember 2022: 0,60 %)

| Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei | Referenzverbindlichkeit | Zeitwert USD | % des Nettovermögens |
|---|------------|-----------------------------|--|----------------|----------------------|
| USD (6.343.750) | 20.12.2028 | ICE Clear U.S. ¹ | Buying default protection on CDX.EM.40 | 193.716 | 0,30 |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt [±] | | | | 193.716 | 0,30 |

¹Zentral abgewickelter Swap.

| | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|-------------------|----------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 70.656.593 | 108,02 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (10,06 %) (31. Dezember 2022: (6,38 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 94.000 € | 81.871 £ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | (477) | (0,00) |
| 30.000 £ | 34.673 € | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 1 | (78) | (0,00) |
| 1.959.318 US\$ | 21.603.742 NOK | 18.01.2024 | BNP Paribas | 4 | (168.793) | (0,26) |
| 961.150 US\$ | 17.390.420 MXN | 18.01.2024 | BNP Paribas | 2 | (63.103) | (0,10) |
| 1.612.649 US\$ | 2.715.052 NZD | 18.01.2024 | BNP Paribas | 3 | (106.492) | (0,16) |
| 3.204.343 US\$ | 2.994.310 € | 18.01.2024 | BNP Paribas | 4 | (105.381) | (0,16) |
| 3.038.203 US\$ | 2.703.866 CHF | 18.01.2024 | BNP Paribas | 5 | (179.616) | (0,27) |
| 971.625 US\$ | 789.158 £ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 2 | (34.481) | (0,05) |
| 1.437.820 US\$ | 15.639.190 SEK | 18.01.2024 | BNP Paribas | 4 | (115.007) | (0,18) |
| 2.457.009 US\$ | 359.495.222 ¥ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 3 | (99.114) | (0,15) |
| 158.998 US\$ | 58.309.235 HUF | 18.01.2024 | BNP Paribas | 1 | (9.148) | (0,01) |
| 3.265.953 US\$ | 4.469.389 CAD | 18.01.2024 | BNP Paribas | 6 | (124.315) | (0,19) |
| 3.262.382 US\$ | 5.066.240 AUD | 18.01.2024 | BNP Paribas | 6 | (196.367) | (0,30) |
| 274.987 US\$ | 256.661.581 CLP | 18.01.2024 | BNP Paribas | 1 | (18.691) | (0,03) |
| 965.669 US\$ | 4.068.270 PLN | 18.01.2024 | BNP Paribas | 2 | (68.706) | (0,11) |
| 321.256 US\$ | 252.708 £ | 18.01.2024 | Citibank NA | 1 | (925) | (0,00) |
| 100.816 US\$ | 1.822.432 MXN | 18.01.2024 | Deutsche Bank AG | 2 | (6.520) | (0,01) |
| 25.327 US\$ | 9.000.000 HUF | 18.01.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | (626) | (0,00) |
| 3.083.291 US\$ | 2.511.188 £ | 18.01.2024 | Deutsche Bank AG | 4 | (118.253) | (0,18) |
| 111.990 US\$ | 1.167.994 SEK | 18.01.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | (3.981) | (0,01) |
| 40.262 US\$ | 55.570 CAD | 18.01.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | (1.890) | (0,00) |
| 310.778 US\$ | 286.969 € | 18.01.2024 | Deutsche Bank AG | 3 | (6.420) | (0,01) |
| 36.722 US\$ | 708.353 ZAR | 18.01.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | (1.961) | (0,00) |
| 1.186.996 US\$ | 21.174.504 MXN | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | (60.131) | (0,09) |
| 805.625 US\$ | 4.023.499 BRL | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 4 | (21.764) | (0,03) |

Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (10,06 %) (31. Dezember 2022: (6,38 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 40.697 US\$ | 54.750.729 KRW | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (1.551) | (0,00) |
| 2.110.365 US\$ | 15.244.013 CNY | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (43.061) | (0,07) |
| 491.983 US\$ | 7.602.613.380 IDR | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (1.162) | (0,00) |
| 3.810.274 US\$ | 41.323.277 SEK | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 6 | (292.749) | (0,45) |
| 2.844.609 US\$ | 4.409.448 AUD | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 7 | (165.745) | (0,25) |
| 2.634.019 US\$ | 3.623.140 CAD | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 5 | (114.323) | (0,18) |
| 957.313 US\$ | 4.019.164 PLN | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (64.577) | (0,10) |
| 162.092 US\$ | 1.163.583 CNY | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (1.497) | (0,00) |
| 2.137.343 US\$ | 1.737.262 £ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | (77.513) | (0,12) |
| 3.896.936 US\$ | 6.502.032 NZD | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 5 | (220.078) | (0,34) |
| 1.289.916 US\$ | 190.320.578 ¥ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (63.322) | (0,10) |
| 1.141.541 US\$ | 1.028.332 CHF | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (82.257) | (0,13) |
| 3.004.878 US\$ | 2.821.896 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 7 | (114.269) | (0,17) |
| 520.117 US\$ | 8.040.424.826 IDR | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 1 | (1.426) | (0,00) |
| 56.604 US\$ | 73.398.220 KRW | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 1 | (33) | (0,00) |
| 43.906 US\$ | 6.286.726 ¥ | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 1 | (794) | (0,00) |
| 1.630.509 US\$ | 30.164.306 MXN | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 2 | (146.094) | (0,22) |
| 3.304.986 US\$ | 2.696.750 £ | 18.01.2024 | Société Générale | 1 | (133.133) | (0,20) |
| 281.381 US\$ | 104.500.000 HUF | 18.01.2024 | Société Générale | 1 | (19.964) | (0,03) |
| 474 US\$ | 5.143 SEK | 18.01.2024 | Société Générale | 1 | (36) | (0,00) |
| 1.767.706 US\$ | 18.752.684 SEK | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 2 | (94.263) | (0,14) |
| 489.453 US\$ | 652.000.000 KRW | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | (13.656) | (0,02) |
| 13.490 US\$ | 97.384 CNY | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 2 | (267) | (0,00) |
| 640.752 US\$ | 595.899.549 CLP | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | (41.088) | (0,06) |
| 19.131 US\$ | 30.000 AUD | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | (1.351) | (0,00) |
| 3.622.637 US\$ | 3.417.089 € | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 5 | (154.399) | (0,24) |
| 51.476 US\$ | 82.793 NZD | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | (948) | (0,00) |
| 1.648.482 US\$ | 1.351.942 £ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 2 | (75.126) | (0,12) |
| 1.630.200 US\$ | 2.238.233 CAD | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 2 | (67.618) | (0,10) |
| 1.045.870 US\$ | 153.180.234 ¥ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | (43.289) | (0,07) |
| 2.099.388 US\$ | 15.281.448 CNY | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | (49.037) | (0,08) |
| 28.332.315 US\$ | 26.602.213 € | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 11 | (1.072.111) | (1,64) |
| 165.221 US\$ | 58.955.378 HUF | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | (4.788) | (0,01) |
| 94.541 US\$ | 374.621 PLN | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | (708) | (0,00) |
| 88.064 US\$ | 118.428 CAD | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 2 | (1.770) | (0,00) |
| 729.707 US\$ | 103.498.103 ¥ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 2 | (6.197) | (0,01) |
| 373.372 US\$ | 6.562.485 MXN | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 2 | (13.142) | (0,02) |
| 2.309.504 US\$ | 1.877.908 £ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 6 | (84.662) | (0,13) |
| 2.290.213 US\$ | 3.523.578 AUD | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 5 | (115.352) | (0,18) |
| 1.946.179 US\$ | 1.743.815 CHF | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 2 | (129.101) | (0,20) |
| 984.369 US\$ | 10.764.007 NOK | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 2 | (75.956) | (0,12) |

Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (10,06 %) (31. Dezember 2022: (6,38 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 560.045 US\$ | 918.473 NZD | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 6 | (21.522) | (0,03) |
| 1.635.028 US\$ | 18.012.086 SEK | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 4 | (153.405) | (0,23) |
| 1.082.408 US\$ | 25.170.465 CZK | 18.01.2024 | UBS AG | 4 | (43.239) | (0,07) |
| 618.106 US\$ | 9.745.387.621 IDR | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (14.030) | (0,02) |
| 373.666 US\$ | 3.915.056 SEK | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (15.063) | (0,02) |
| 671.566 US\$ | 1.111.912 NZD | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (32.484) | (0,05) |
| 1.623.068 US\$ | 17.807.754 NOK | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | (131.113) | (0,20) |
| 1.283.974 US\$ | 188.942.539 ¥ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (59.466) | (0,09) |
| 45.150 US\$ | 35.622 £ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (265) | (0,00) |
| 6.120.864 US\$ | 5.402.953 CHF | 18.01.2024 | UBS AG | 4 | (309.087) | (0,47) |
| 321.005 US\$ | 117.115.360 HUF | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (16.720) | (0,03) |
| 2.680.610 US\$ | 2.501.258 € | 18.01.2024 | UBS AG | 4 | (84.123) | (0,13) |
| 952.705 US\$ | 4.154.450 PLN | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | (103.583) | (0,16) |
| 3.223.389 US\$ | 5.390.193 NZD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (189.620) | (0,29) |
| 2.564.109 US\$ | 4.023.250 AUD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | (182.585) | (0,28) |
| 247.436 US\$ | 9.000.000 THB | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (16.604) | (0,03) |
| 815.093 US\$ | 668.870 £ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 4 | (37.657) | (0,06) |
| 1.506.493 US\$ | 1.415.149 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 8 | (57.725) | (0,09) |
| 503.563 US\$ | 8.700.000 MXN | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (8.846) | (0,01) |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 84 € | 93 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (0) | (0,00) |
| 206 US\$ | 195 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (9) | (0,00) |
| 97 US\$ | 89 € | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (1) | (0,00) |
| 165 US\$ | 154 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | (5) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 208 £ | 266 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (1) | (0,00) |
| 367 US\$ | 302 £ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (18) | (0,00) |
| 457 US\$ | 368 £ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | (12) | (0,00) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | (6.577.836) | (10,06) |

Futures-Kontrakte (0,54 %) (31. Dezember 2022: (0,80 %))

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---|---------------------------------|----------------------|
| 2 | Euro-BOBL Call Option on Future February 2024, Strike Price EUR 118 | (435) | (0,00) |
| (5) | Euro-BOBL Future March 2024 | (155) | (0,00) |
| (24) | Euro-BTP Future March 2024 | (107.990) | (0,16) |
| (11) | Euro-OAT Future March 2024 | (53.399) | (0,08) |
| (39) | US Treasury 10-Year Ultra Future March 2024 | (194.594) | (0,30) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten [*] | | (356.573) | (0,54) |

Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Credit-Default-Swap-Kontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (0,09 %))

| | Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei | Referenzverbindlichkeit | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|-------------|------------|-----------------------------|--|------------------|------------------------------|
| EUR | 9.282.000 | 20.12.2028 | ICE Clear U.S. ¹ | Buying default protection on iTRAXX Europe Crossover S40 | (821.571) | (1,26) |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt [±] | | | | | (821.571) | (1,26) |

¹Zentral abgewickelter Swap.

Zinsswap-Kontrakte (0,00 %) (31. Dezember 2022: (0,00 %))

| | Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei | Erhalt/(Zahlung) [#] | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Netto- vermögens |
|---|---------------|------------|-------------------------------|-------------------------------|--------------------|--------------------|---------------------------------------|------------------------------|
| KRW | 1.267.973.000 | 11.08.2032 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 2,88 % | 3M KORIBOR | (7) | (0,00) |
| KRW | 730.294.000 | 18.02.2032 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 2,37 % | 3M KORIBOR | (20) | (0,00) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten [∞] | | | | | | | (27) | (0,00) |

[#]Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

¹Zentral abgewickelter Swap.

| | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--------------------|------------------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (7.756.007) | (11,86) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | 62.900.586 | 96,16 |
| Sonstiges Nettovermögen | 2.509.177 | 3,84 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | 65.409.763 | 100,00 |

| Portfolioanalyse | US\$ | % des Gesamtver- mögens |
|---|-------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 37.941.278 | 51,13 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 26.810.069 | 36,13 |
| † Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente | 177.636 | 0,24 |
| μ Investmentfonds | 21.165 | 0,03 |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 482.471 | 0,65 |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap | (2.532.033) | (3,41) |
| Anlagen insgesamt | 62.900.586 | 84,77 |

Global Real Estate Securities - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|--|---------------------------------|------------------|------------------------------|
| Aktien 14,74 % (31. Dezember 2022: 17,55 %) | | | |
| Kanadischer Dollar | | | |
| 12.807 | Tricon Residential Inc | 117.134 | 0,57 |
| Kanadischer Dollar insgesamt | | 117.134 | 0,57 |
| Euro | | | |
| 3.988 | Cellnex Telecom SA | 157.095 | 0,77 |
| Euro insgesamt | | 157.095 | 0,77 |
| Hongkong-Dollar | | | |
| 38.000 | CK Asset Holdings Ltd | 190.765 | 0,94 |
| 322.000 | Sino Land Co Ltd | 350.101 | 1,71 |
| 22.883 | Sun Hung Kai Properties Ltd | 247.481 | 1,21 |
| Hongkong-Dollar insgesamt | | 788.347 | 3,86 |
| Japanischer Yen | | | |
| 20.500 | Mitsui Fudosan Co Ltd | 502.830 | 2,46 |
| 8.600 | Nomura Real Estate Holdings Inc | 226.255 | 1,10 |
| Japanischer Yen insgesamt | | 729.085 | 3,56 |
| Britisches Pfund | | | |
| 113.868 | Grainger Plc | 383.800 | 1,87 |
| Britisches Pfund insgesamt | | 383.800 | 1,87 |
| Singapur-Dollar | | | |
| 112.500 | UOL Group Ltd | 535.593 | 2,62 |
| Singapur-Dollar insgesamt | | 535.593 | 2,62 |
| Schweizer Franken | | | |
| 1.099 | PSP Swiss Property AG | 153.558 | 0,75 |
| 1.418 | Swiss Prime Site AG | 151.378 | 0,74 |
| Schweizer Franken insgesamt | | 304.936 | 1,49 |
| Aktien insgesamt * | | 3.015.990 | 14,74 |
| Immobilienaktiengesellschaften 83,44 % (31. Dezember 2022: 77,80 %) | | | |
| Australischer Dollar | | | |
| 119.489 | Charter Hall Retail REIT | 294.335 | 1,44 |
| 69.376 | GPT Group | 219.652 | 1,08 |
| 340.133 | Region RE Ltd | 524.523 | 2,56 |
| Australischer Dollar insgesamt | | 1.038.510 | 5,08 |

Global Real Estate Securities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|-------------------------------------|------------------|----------------------|
| Immobilienaktiengesellschaften 83,44 % (31. Dezember 2022: 77,80 %) (Fortsetzung) | | | |
| Kanadischer Dollar | | | |
| 8.631 | Canadian Apartment Properties REIT | 319.424 | 1,56 |
| 27.678 | RioCan Real Estate Investment Trust | 390.842 | 1,91 |
| Kanadischer Dollar insgesamt | | 710.266 | 3,47 |
| Euro | | | |
| 3.283 | Gecina SA | 399.285 | 1,95 |
| 33.876 | Merlin Properties Socimi SA | 376.456 | 1,84 |
| 7.014 | Shurgard Self Storage Ltd | 347.576 | 1,70 |
| 2.829 | Unibail-Rodamco-Westfield | 209.129 | 1,02 |
| Euro insgesamt | | 1.332.446 | 6,51 |
| Hongkong-Dollar | | | |
| 28.860 | Link REIT | 162.068 | 0,79 |
| Hongkong-Dollar insgesamt | | 162.068 | 0,79 |
| Japanischer Yen | | | |
| 359 | LaSalle Logiport REIT | 387.062 | 1,89 |
| 54 | Nippon Building Fund Inc | 234.033 | 1,15 |
| 202 | Nippon Prologis REIT Inc | 388.870 | 1,90 |
| Japanischer Yen insgesamt | | 1.009.965 | 4,94 |
| Britisches Pfund | | | |
| 26.977 | Great Portland Estates Plc | 144.439 | 0,71 |
| 26.892 | Segro Plc | 303.875 | 1,48 |
| 26.383 | UNITE Group Plc | 351.129 | 1,72 |
| Britisches Pfund insgesamt | | 799.443 | 3,91 |
| Singapur-Dollar | | | |
| 167.400 | Mapletree Pan Asia Commercial Trust | 199.240 | 0,97 |
| Singapur-Dollar insgesamt | | 199.240 | 0,97 |
| US-Dollar | | | |
| 1.361 | American Homes 4 Rent Class A | 48.941 | 0,24 |
| 5.174 | American Tower Corp | 1.116.963 | 5,46 |
| 10.018 | Apartment Income REIT Corp | 347.925 | 1,70 |
| 1.260 | AvalonBay Communities Inc | 235.897 | 1,15 |
| 2.172 | Boston Properties Inc | 152.409 | 0,74 |
| 4.861 | Crown Castle Inc | 559.939 | 2,74 |

Global Real Estate Securities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|-------------------------------------|-------------------|----------------------|
| Immobilienaktiengesellschaften 83,44 % (31. Dezember 2022: 77,80 %) (Fortsetzung) | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | |
| 521 | EastGroup Properties Inc | 95.624 | 0,47 |
| 999 | Equinix Inc | 804.585 | 3,93 |
| 3.196 | Equity LifeStyle Properties Inc | 225.446 | 1,10 |
| 4.640 | Equity Residential | 283.782 | 1,39 |
| 1.574 | Essex Property Trust Inc | 390.258 | 1,91 |
| 3.244 | Extra Space Storage Inc | 520.110 | 2,54 |
| 38.790 | Hudson Pacific Properties Inc | 361.135 | 1,76 |
| 3.092 | Invitation Homes Inc | 105.468 | 0,51 |
| 4.498 | Iron Mountain Inc | 314.770 | 1,54 |
| 22.399 | Kimco Realty Corp | 477.323 | 2,33 |
| 4.930 | Omega Healthcare Investors Inc | 151.154 | 0,74 |
| 7.257 | Prologis Inc | 967.358 | 4,73 |
| 3.067 | Public Storage | 935.435 | 4,57 |
| 7.694 | Realty Income Corp | 441.790 | 2,16 |
| 7.002 | Retail Opportunity Investments Corp | 98.238 | 0,48 |
| 2.623 | Rexford Industrial Realty Inc | 147.150 | 0,72 |
| 1.726 | SBA Communications Corp Class A | 437.869 | 2,14 |
| 4.130 | Simon Property Group Inc | 589.103 | 2,88 |
| 2.464 | Sun Communities Inc | 329.314 | 1,61 |
| 7.790 | Urban Edge Properties | 142.557 | 0,70 |
| 6.939 | Ventas Inc | 345.840 | 1,69 |
| 12.523 | VICI Properties Inc Class A | 399.233 | 1,95 |
| 5.326 | Welltower Inc | 480.245 | 2,35 |
| 9.027 | Weyerhaeuser Co | 313.869 | 1,54 |
| US-Dollar insgesamt | | 11.819.730 | 57,77 |
| Immobilienaktiengesellschaften insgesamt * | | 17.071.668 | 83,44 |
| Anlagen insgesamt | | 20.087.658 | 98,18 |

Devisenterminkontrakte 2,07 % (31. Dezember 2022: 2,22 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 456.034 € | 494.179 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 7 | 9.892 | 0,06 |
| 5.361.355 € | 5.718.455 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 10 | 207.653 | 1,01 |
| 5.128.261 € | 5.467.788 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 23 | 200.670 | 0,98 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 4.198 £ | 5.177 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 6 | 175 | 0,00 |
| 78.915 £ | 97.015 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 5 | 3.596 | 0,02 |
| 16.620 £ | 20.698 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 14 | 492 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | 422.478 | 2,07 |

Global Real Estate Securities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|-------------------|------------------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 20.510.136 | 100,25 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (1,23 %) (31. Dezember 2022: (0,38 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|------------------------------------|------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 15.291 € | 16.935 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | (33) | (0,00) |
| 423.551 US\$ | 395.459 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 5 | (13.564) | (0,07) |
| 264.014 US\$ | 245.621 € | 18.01.2024 | UBS AG | 3 | (7.481) | (0,04) |
| 10.197.162 US\$ | 9.432.620 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 22 | (229.066) | (1,12) |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 2.137 £ | 2.733 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (9) | (0,00) |
| 584 £ | 745 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (0) | (0,00) |
| 4.003 US\$ | 3.262 £ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | (155) | (0,00) |
| 4.678 US\$ | 3.775 £ | 18.01.2024 | UBS AG | 4 | (135) | (0,00) |
| 6.444 US\$ | 5.242 £ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 7 | (241) | (0,00) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | (250.684) | (1,23) |

| | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|---|-------------------|------------------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (250.684) | (1,23) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | 20.259.452 | 99,02 |
| Sonstiges Nettovermögen | 200.561 | 0,98 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | 20.460.013 | 100,00 |

| Portfolioanalyse | US\$ | % des Gesamtver- mögens |
|---|-------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 20.087.658 | 96,40 |
| [∞] OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente | 171.794 | 0,82 |
| Anlagen insgesamt | 20.259.452 | 97,22 |

Global Sustainable Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|--|---------------------------|-------------------|------------------------------|
| Aktien 99,37 % (31. Dezember 2022: 99,20 %) | | | |
| Dänische Krone | | | |
| 22.781 | Novo Nordisk A/S Class B | 2.356.638 | 1,52 |
| Dänische Krone insgesamt | | 2.356.638 | 1,52 |
| Euro | | | |
| 2.206 | Adyen NV | 2.842.838 | 1,84 |
| 48.948 | Alfen NV | 3.259.364 | 2,11 |
| 4.904 | ASML Holding NV | 3.692.908 | 2,39 |
| 93.223 | HelloFresh SE | 1.473.626 | 0,95 |
| 5.575 | L'Oreal SA | 2.775.294 | 1,79 |
| 17.603 | Schneider Electric SE | 3.534.740 | 2,29 |
| Euro insgesamt | | 17.578.770 | 11,37 |
| Japanischer Yen | | | |
| 66.400 | Recruit Holdings Co Ltd | 2.808.506 | 1,82 |
| Japanischer Yen insgesamt | | 2.808.506 | 1,82 |
| Norwegische Krone | | | |
| 73.159 | Bakkafrost P/F | 3.832.389 | 2,48 |
| Norwegische Krone insgesamt | | 3.832.389 | 2,48 |
| Britisches Pfund | | | |
| 146.702 | 3i Group Plc | 4.527.650 | 2,93 |
| Britisches Pfund insgesamt | | 4.527.650 | 2,93 |
| Schwedische Krone | | | |
| 89.486 | Assa Abloy AB Class B | 2.577.711 | 1,67 |
| 103.374 | Atlas Copco AB Class A | 1.780.197 | 1,15 |
| Schwedische Krone insgesamt | | 4.357.908 | 2,82 |
| Schweizer Franken | | | |
| 37.517 | Nestle SA | 4.346.560 | 2,81 |
| 2.444 | Partners Group Holding AG | 3.522.333 | 2,28 |
| 17.303 | Straumann Holding AG | 2.787.723 | 1,80 |
| 2.871 | VAT Group AG | 1.437.803 | 0,93 |
| Schweizer Franken insgesamt | | 12.094.419 | 7,82 |
| US-Dollar | | | |
| 20.671 | Abbott Laboratories | 2.275.257 | 1,47 |
| 5.300 | Adobe Inc | 3.161.980 | 2,05 |
| 62.390 | Alphabet Inc Class A | 8.715.259 | 5,64 |

Global Sustainable Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|------------------------------|--------------------|--|
| Aktien 99,37 % (31. Dezember 2022: 99,20 %) (Fortsetzung) | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | |
| 51.146 | Amazon.com Inc | 7.771.123 | 5,03 |
| 16.993 | Applied Materials Inc | 2.754.056 | 1,78 |
| 40.721 | Brown & Brown Inc | 2.895.670 | 1,87 |
| 10.445 | Danaher Corp | 2.416.346 | 1,56 |
| 6.836 | Elevance Health Inc | 3.223.584 | 2,09 |
| 21.604 | Estee Lauder Cos Inc Class A | 3.159.585 | 2,04 |
| 5.826 | Intuit Inc | 3.641.425 | 2,36 |
| 8.607 | Mastercard Inc Class A | 3.670.972 | 2,37 |
| 35.979 | Microsoft Corp | 13.529.543 | 8,75 |
| 7.668 | Moody's Corp | 2.994.814 | 1,94 |
| 46.994 | Nasdaq Inc | 2.732.231 | 1,77 |
| 10.556 | Netflix Inc | 5.139.505 | 3,32 |
| 39.483 | NIKE Inc Class B | 4.286.669 | 2,77 |
| 6.537 | Nordson Corp | 1.726.814 | 1,12 |
| 7.934 | S&P Global Inc | 3.495.086 | 2,26 |
| 21.006 | SolarEdge Technologies Inc | 1.966.162 | 1,27 |
| 38.518 | Starbucks Corp | 3.698.113 | 2,39 |
| 5.919 | Synopsys Inc | 3.047.752 | 1,97 |
| 8.810 | Thermo Fisher Scientific Inc | 4.676.260 | 3,03 |
| 6.768 | Ulta Beauty Inc | 3.316.252 | 2,15 |
| 10.310 | UnitedHealth Group Inc | 5.427.906 | 3,51 |
| 13.865 | Visa Inc Class A | 3.609.753 | 2,34 |
| 13.756 | Zoetis Inc Class A | 2.715.022 | 1,76 |
| US-Dollar insgesamt | | 106.047.139 | 68,61 |
| Aktien insgesamt * | | 153.603.419 | 99,37 |
| Anlagen insgesamt | | 153.603.419 | 99,37 |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | | 153.603.419 | 99,37 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | | 153.603.419 | 99,37 |
| Sonstiges Nettovermögen | | 969.876 | 0,63 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | | 154.573.295 | 100,00 |
| Portfolioanalyse | | US\$ | % des Gesamtver- mögens |
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | | 153.603.419 | 98,95 |
| Anlagen insgesamt | | 153.603.419 | 98,95 |

Global Sustainable Value - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|--|---|------------------|------------------------------|
| Aktien 97,01 % (31. Dezember 2022: 97,79 %) | | | |
| Australischer Dollar | | | |
| 17.399 | Brambles Ltd* | 161.462 | 0,29 |
| 35.789 | Fortescue Ltd* | 708.687 | 1,28 |
| 5.765 | National Australia Bank Ltd* | 120.766 | 0,22 |
| 2.039 | Rio Tinto Ltd* | 188.745 | 0,34 |
| 66.677 | Santos Ltd* | 345.778 | 0,62 |
| 39.359 | Telstra Group Ltd* | 106.352 | 0,19 |
| Australischer Dollar insgesamt | | 1.631.790 | 2,94 |
| Brasilianischer Real | | | |
| 49.378 | Ambev SA* | 138.772 | 0,25 |
| 8.054 | B3 SA - Brasil Bolsa Balcao* | 24.097 | 0,04 |
| 41.366 | Banco Bradesco SA - Preferred Shares* | 144.251 | 0,26 |
| 13.155 | Banco do Brasil SA* | 149.960 | 0,27 |
| 15.723 | BB Seguridade Participacoes SA* | 109.200 | 0,20 |
| Brasilianischer Real insgesamt | | 566.280 | 1,02 |
| Kanadischer Dollar | | | |
| 457 | CGI Inc* | 49.197 | 0,09 |
| 1.891 | George Weston Ltd** | 235.909 | 0,42 |
| 5.571 | Hydro One Ltd** | 167.730 | 0,30 |
| 2.138 | iA Financial Corp Inc** | 146.463 | 0,27 |
| 3.708 | Loblaw Cos Ltd** | 360.733 | 0,65 |
| 28.463 | Manulife Financial Corp* | 632.031 | 1,14 |
| 1.952 | Metro Inc** | 101.538 | 0,18 |
| 1.017 | Nutrien Ltd* | 57.576 | 0,10 |
| 1.854 | Quebecor Inc Class B** | 44.318 | 0,08 |
| 3.981 | Toronto-Dominion Bank* | 258.496 | 0,47 |
| Kanadischer Dollar insgesamt | | 2.053.991 | 3,70 |
| Euro | | | |
| 2.486 | AXA SA* | 80.984 | 0,14 |
| 4.473 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA* | 40.646 | 0,07 |
| 3.558 | Bayerische Motoren Werke AG* | 396.100 | 0,72 |
| 856 | Bayerische Motoren Werke AG - Preferred Shares* | 85.055 | 0,15 |
| 2.984 | BNP Paribas SA* | 206.314 | 0,37 |
| 672 | Cie de Saint-Gobain SA* | 49.483 | 0,09 |
| 3.906 | Credit Agricole SA* | 55.453 | 0,10 |
| 7.003 | Deutsche Post AG* | 346.992 | 0,63 |
| 1.298 | Eiffage SA* | 139.111 | 0,25 |

Global Sustainable Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---|------------------|----------------------|
| Aktien 97,01 % (31. Dezember 2022: 97,79 %) (Fortsetzung) | | | |
| Euro (Fortsetzung) | | | |
| 20.684 | Eni SpA* | 350.680 | 0,63 |
| 888 | Eurazeo SE* | 70.480 | 0,13 |
| 30.629 | Iberdrola SA* | 401.613 | 0,73 |
| 3.460 | Industria de Diseno Textil SA* | 150.705 | 0,27 |
| 2.021 | Randstad NV* | 126.627 | 0,23 |
| 6.513 | Redeia Corp SA* | 107.271 | 0,19 |
| 9.946 | Repsol SA* | 147.773 | 0,27 |
| 1.728 | Sanofi SA* | 171.337 | 0,31 |
| 1.017 | SAP SE* | 156.696 | 0,28 |
| 2.300 | STMicroelectronics NV* | 114.954 | 0,21 |
| 22.383 | Telefonica SA* | 87.380 | 0,16 |
| 11.254 | TotalEnergies SE* | 765.795 | 1,38 |
| 14.194 | UniCredit SpA* | 385.165 | 0,69 |
| 1.749 | Vinci SA* | 219.672 | 0,40 |
| 552 | Wendel SE* | 49.178 | 0,09 |
| 613 | Wolters Kluwer NV* | 87.149 | 0,16 |
| | Euro insgesamt | 4.792.613 | 8,65 |
| Hongkong-Dollar | | | |
| 188.000 | Agricultural Bank of China Ltd - H Shares* | 72.469 | 0,13 |
| 33.900 | Alibaba Group Holding Ltd* | 328.209 | 0,59 |
| 24.000 | Aluminum Corp of China Ltd - H Shares* | 11.987 | 0,02 |
| 1.150 | Baidu Inc Class A* | 17.099 | 0,03 |
| 172.000 | Bank of China Ltd - H Shares* | 65.641 | 0,12 |
| 384.000 | China Construction Bank Corp - H Shares* | 228.672 | 0,41 |
| 7.000 | China Life Insurance Co Ltd - H Shares* | 9.072 | 0,02 |
| 16.000 | China Merchants Bank Co Ltd - H Shares* | 55.734 | 0,10 |
| 4.500 | China Overseas Land & Investment Ltd* | 7.930 | 0,01 |
| 14.000 | China Resources Land Ltd* | 50.201 | 0,09 |
| 37.000 | CITIC Ltd* | 36.959 | 0,07 |
| 14.000 | CSPC Pharmaceutical Group Ltd* | 13.017 | 0,02 |
| 313.000 | Industrial & Commercial Bank of China Ltd - H Shares* | 153.122 | 0,28 |
| 1.250 | JD.com Inc Class A* | 18.009 | 0,03 |
| 5.500 | Longfor Group Holdings Ltd* | 8.804 | 0,02 |
| 4.110 | Meituan Class B* | 43.108 | 0,08 |
| 6.900 | NetEase Inc* | 124.241 | 0,22 |
| 27.500 | Ping An Insurance Group Co of China Ltd - H Shares* | 124.495 | 0,23 |
| 36.800 | Sinopharm Group Co Ltd - H Shares* | 96.376 | 0,17 |
| 3.500 | Sun Hung Kai Properties Ltd* | 37.853 | 0,07 |

Global Sustainable Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---|------------------|----------------------|
| Aktien 97,01 % (31. Dezember 2022: 97,79 %) (Fortsetzung) | | | |
| Hongkong-Dollar (Fortsetzung) | | | |
| 3.300 | Tencent Holdings Ltd* | 124.079 | 0,22 |
| 5.000 | Wuxi Biologics Cayman Inc* | 18.954 | 0,04 |
| Hongkong-Dollar insgesamt | | 1.646.031 | 2,97 |
| Indonesische Rupiah | | | |
| 131.831 | Bank Central Asia Tbk PT* | 80.484 | 0,15 |
| 438.353 | Telkom Indonesia Persero Tbk PT* | 112.457 | 0,20 |
| Indonesische Rupiah insgesamt | | 192.941 | 0,35 |
| Japanischer Yen | | | |
| 5.900 | Astellas Pharma Inc* | 70.559 | 0,13 |
| 2.500 | Bridgestone Corp* | 103.561 | 0,19 |
| 12.900 | Canon Inc* | 331.238 | 0,60 |
| 3.200 | Hitachi Ltd* | 230.841 | 0,42 |
| 53.200 | Honda Motor Co Ltd* | 553.208 | 1,00 |
| 10.600 | KDDI Corp* | 337.293 | 0,61 |
| 15.600 | Mitsubishi Chemical Group Corp* | 95.605 | 0,17 |
| 1.400 | Mitsui & Co Ltd* | 52.612 | 0,09 |
| 5.200 | Mizuho Financial Group Inc* | 88.984 | 0,16 |
| 1.300 | MS&AD Insurance Group Holdings Inc* | 51.140 | 0,09 |
| 1.100 | Nippon Express Holdings Inc* | 62.529 | 0,11 |
| 80.500 | Nippon Telegraph & Telephone Corp* | 98.384 | 0,17 |
| 2.300 | Nitto Denko Corp* | 172.117 | 0,31 |
| 1.900 | Shionogi & Co Ltd* | 91.617 | 0,17 |
| 3.300 | Sumitomo Mitsui Financial Group Inc* | 161.044 | 0,29 |
| 4.400 | Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc* | 84.455 | 0,15 |
| 10.900 | Takeda Pharmaceutical Co Ltd* | 313.439 | 0,56 |
| 9.700 | Tokio Marine Holdings Inc* | 242.810 | 0,44 |
| Japanischer Yen insgesamt | | 3.141.436 | 5,66 |
| Mexikanischer Peso | | | |
| 8.779 | Fomento Economico Mexicano SAB de CV* | 114.807 | 0,21 |
| 20.533 | Grupo Financiero Banorte SAB de CV Class O* | 207.458 | 0,37 |
| 13.487 | Grupo Mexico SAB de CV* | 75.166 | 0,14 |
| Mexikanischer Peso insgesamt | | 397.431 | 0,72 |
| Neuer taiwanesischer Dollar | | | |
| 51.000 | ASE Technology Holding Co Ltd* | 224.336 | 0,40 |
| 79.650 | China Steel Corp* | 70.072 | 0,13 |
| 32.492 | Chunghwa Telecom Co Ltd* | 127.044 | 0,23 |
| 11.000 | Hon Hai Precision Industry Co Ltd* | 37.455 | 0,07 |

Global Sustainable Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|------------------|------------------------------|
| Aktien 97,01 % (31. Dezember 2022: 97,79 %) (Fortsetzung) | | | |
| Neuer taiwanesischer Dollar (Fortsetzung) | | | |
| 6.624 | MediaTek Inc* | 219.070 | 0,40 |
| 9.559 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd* | 184.698 | 0,33 |
| 30.000 | Uni-President Enterprises Corp* | 72.824 | 0,13 |
| 62.000 | United Microelectronics Corp* | 106.261 | 0,19 |
| Neuer taiwanesischer Dollar insgesamt | | 1.041.760 | 1,88 |
| Neuseeländischer Dollar | | | |
| 33.835 | Spark New Zealand Ltd* | 110.969 | 0,20 |
| Neuseeländischer Dollar insgesamt | | 110.969 | 0,20 |
| Norwegische Krone | | | |
| 11.482 | Equinor ASA* | 364.222 | 0,66 |
| Norwegische Krone insgesamt | | 364.222 | 0,66 |
| Britisches Pfund | | | |
| 3.904 | 3i Group Plc* | 120.489 | 0,22 |
| 146.481 | Barclays Plc* | 287.159 | 0,52 |
| 63.723 | BP Plc* | 378.673 | 0,68 |
| 1.692 | Burberry Group Plc* | 30.542 | 0,06 |
| 6.016 | HSBC Holdings Plc* | 48.738 | 0,09 |
| 432.300 | Lloyds Banking Group Plc* | 262.928 | 0,47 |
| 43.741 | NatWest Group Plc* | 122.340 | 0,22 |
| 2.264 | Next Plc* | 234.297 | 0,42 |
| 3.482 | RELX Plc* | 138.048 | 0,25 |
| 28.921 | Shell Plc* | 948.073 | 1,71 |
| 1.821 | Unilever Plc* | 88.214 | 0,16 |
| Britisches Pfund insgesamt | | 2.659.501 | 4,80 |
| Singapur-Dollar | | | |
| 11.500 | Oversea-Chinese Banking Corp Ltd* | 113.335 | 0,20 |
| 17.200 | Singapore Airlines Ltd* | 85.537 | 0,15 |
| 17.400 | Wilmar International Ltd* | 47.091 | 0,09 |
| Singapur-Dollar insgesamt | | 245.963 | 0,44 |
| Südafrikanischer Rand | | | |
| 9.603 | FirstRand Ltd* | 38.601 | 0,07 |
| 8.644 | Impala Platinum Holdings Ltd* | 43.141 | 0,08 |
| 15.945 | Sanlam Ltd* | 63.475 | 0,11 |
| 5.341 | Sasol Ltd* | 54.115 | 0,10 |
| Südafrikanischer Rand insgesamt | | 199.332 | 0,36 |

Global Sustainable Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|-------------------------------------|------------------|------------------------------|
| Aktien 97,01 % (31. Dezember 2022: 97,79 %) (Fortsetzung) | | | |
| Südkoreanischer Won | | | |
| 134 | Hyundai Mobis Co Ltd* | 24.550 | 0,04 |
| 1.183 | Hyundai Motor Co* | 186.092 | 0,34 |
| 2.570 | KB Financial Group Inc* | 107.225 | 0,19 |
| 1.438 | Kia Corp* | 111.205 | 0,20 |
| 700 | LG Corp* | 46.518 | 0,08 |
| 5.262 | Samsung Electronics Co Ltd* | 319.387 | 0,58 |
| Südkoreanischer Won insgesamt | | 794.977 | 1,43 |
| Schwedische Krone | | | |
| 10.773 | Nordea Bank Abp* | 133.986 | 0,24 |
| Schwedische Krone insgesamt | | 133.986 | 0,24 |
| Schweizer Franken | | | |
| 3.474 | ABB Ltd* | 153.960 | 0,28 |
| 882 | Kuehne + Nagel International AG* | 303.693 | 0,55 |
| 3.553 | Novartis AG* | 358.276 | 0,64 |
| 722 | Roche Holding AG* | 209.742 | 0,38 |
| 196 | Swiss Re AG* | 22.021 | 0,04 |
| 144 | Swisscom AG* | 86.573 | 0,16 |
| 1.851 | UBS Group AG* | 57.400 | 0,10 |
| Schweizer Franken insgesamt | | 1.191.665 | 2,15 |
| US-Dollar | | | |
| 5.205 | AbbVie Inc* | 806.619 | 1,45 |
| 1.185 | Accenture Plc Class A* | 415.828 | 0,75 |
| 4.993 | Aflac Inc* | 411.922 | 0,75 |
| 6.766 | Alphabet Inc Class A* | 945.143 | 1,70 |
| 4.112 | Alphabet Inc Class C* | 579.504 | 1,05 |
| 1.315 | American Express Co* | 246.352 | 0,44 |
| 1.695 | Ameriprise Financial Inc* | 643.812 | 1,16 |
| 1.136 | Amgen Inc* | 327.191 | 0,59 |
| 621 | Apollo Global Management Inc* | 57.871 | 0,10 |
| 5.877 | Apple Inc* | 1.131.499 | 2,04 |
| 3.893 | Applied Materials Inc* | 630.939 | 1,14 |
| 4.666 | Bank of America Corp* | 157.104 | 0,28 |
| 2.451 | Bank of New York Mellon Corp* | 127.574 | 0,23 |
| 645 | Broadcom Inc* | 719.981 | 1,30 |
| 1.955 | Cardinal Health Inc* | 197.064 | 0,36 |
| 2.929 | Caterpillar Inc* | 866.017 | 1,56 |
| 1.386 | Cencora Inc* | 284.657 | 0,52 |
| 21 | Chipotle Mexican Grill Inc Class A* | 48.026 | 0,09 |

Global Sustainable Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|--|---------------|----------------------|
| Aktien 97,01 % (31. Dezember 2022: 97,79 %) (Fortsetzung) | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | |
| 1.607 | Chubb Ltd* | 363.182 | 0,65 |
| 2.180 | Cigna Corp* | 652.801 | 1,18 |
| 73 | Cintas Corp* | 43.994 | 0,08 |
| 14.791 | Cisco Systems Inc* | 747.241 | 1,35 |
| 10.415 | Citigroup Inc* | 535.748 | 0,97 |
| 5.009 | Coca-Cola Europacific Partners Plc* | 334.301 | 0,60 |
| 1.990 | Cognizant Technology Solutions Corp Class A* | 150.305 | 0,27 |
| 622 | Colgate-Palmolive Co* | 49.580 | 0,09 |
| 21.255 | Comcast Corp Class A* | 932.032 | 1,68 |
| 19.406 | CSX Corp* | 672.806 | 1,21 |
| 1.292 | DR Horton Inc* | 196.358 | 0,35 |
| 4.812 | Edison International* | 344.010 | 0,62 |
| 1.505 | Electronic Arts Inc* | 205.899 | 0,37 |
| 528 | Elevance Health Inc* | 248.984 | 0,45 |
| 100 | Eli Lilly & Co* | 58.292 | 0,11 |
| 255 | Everest Group Ltd* | 90.163 | 0,16 |
| 3.360 | Expeditors International of Washington Inc* | 427.392 | 0,77 |
| 3.171 | Ferguson Plc* | 612.225 | 1,10 |
| 373 | Fiserv Inc* | 49.549 | 0,09 |
| 7.458 | Fox Corp Class B* | 206.214 | 0,37 |
| 1.166 | General Mills Inc* | 75.953 | 0,14 |
| 9.255 | Gilead Sciences Inc* | 749.747 | 1,35 |
| 165 | Goldman Sachs Group Inc* | 63.652 | 0,11 |
| 6.896 | Halliburton Co* | 249.291 | 0,45 |
| 6.949 | Hartford Financial Services Group Inc* | 558.561 | 1,01 |
| 1.463 | HCA Healthcare Inc* | 396.005 | 0,71 |
| 1.153 | Hewlett Packard Enterprise Co* | 19.578 | 0,03 |
| 1.362 | Home Depot Inc* | 472.001 | 0,85 |
| 769 | Humana Inc* | 352.056 | 0,63 |
| 947 | Illinois Tool Works Inc* | 248.057 | 0,45 |
| 2.927 | International Business Machines Corp* | 478.711 | 0,86 |
| 3.751 | Johnson & Johnson* | 587.932 | 1,06 |
| 2.314 | JPMorgan Chase & Co* | 393.611 | 0,71 |
| 1.314 | Kimberly-Clark Corp* | 159.664 | 0,29 |
| 839 | KLA Corp* | 487.711 | 0,88 |
| 5.039 | Kroger Co* | 230.333 | 0,41 |
| 417 | Lam Research Corp* | 326.619 | 0,59 |
| 128 | Linde Plc* | 52.571 | 0,09 |
| 319 | Lockheed Martin Corp* | 144.583 | 0,26 |
| 1.360 | Loews Corp* | 94.642 | 0,17 |
| 1.403 | LyondellBasell Industries NV Class A* | 133.397 | 0,24 |

Global Sustainable Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|-------------------------------------|---------------|----------------------|
| Aktien 97,01 % (31. Dezember 2022: 97,79 %) (Fortsetzung) | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | |
| 456 | Marriott International Inc Class A* | 102.833 | 0,19 |
| 631 | Marsh & McLennan Cos Inc* | 119.555 | 0,22 |
| 553 | Mastercard Inc Class A* | 235.860 | 0,43 |
| 1.496 | McDonald's Corp* | 443.579 | 0,80 |
| 202 | McKesson Corp* | 93.522 | 0,17 |
| 7.461 | Merck & Co Inc* | 813.398 | 1,47 |
| 329 | Meta Platforms Inc Class A* | 116.453 | 0,21 |
| 2.637 | Microchip Technology Inc* | 237.805 | 0,43 |
| 1.632 | Microsoft Corp* | 613.697 | 1,10 |
| 3.051 | Molson Coors Beverage Co Class B* | 186.752 | 0,34 |
| 2.772 | Morgan Stanley* | 258.489 | 0,47 |
| 275 | Motorola Solutions Inc* | 86.100 | 0,16 |
| 3.157 | Nucor Corp* | 549.445 | 0,99 |
| 40 | NVR Inc* | 280.018 | 0,51 |
| 1.007 | NXP Semiconductors NV* | 231.288 | 0,41 |
| 9.549 | Occidental Petroleum Corp* | 570.171 | 1,03 |
| 2.242 | Owens Corning* | 332.332 | 0,60 |
| 568 | PACCAR Inc* | 55.465 | 0,10 |
| 1.253 | Packaging Corp of America* | 204.126 | 0,37 |
| 773 | Parker-Hannifin Corp* | 356.121 | 0,64 |
| 556 | PDD Holdings Inc ADR* | 81.348 | 0,14 |
| 845 | PepsiCo Inc* | 143.515 | 0,26 |
| 2.590 | PNC Financial Services Group Inc* | 401.061 | 0,72 |
| 2.195 | Procter & Gamble Co* | 321.655 | 0,58 |
| 5.007 | PulteGroup Inc* | 516.823 | 0,93 |
| 709 | QUALCOMM Inc* | 102.543 | 0,18 |
| 681 | Reliance Steel & Aluminum Co* | 190.462 | 0,34 |
| 827 | Schlumberger Ltd* | 43.037 | 0,08 |
| 802 | SEI Investments Co* | 50.967 | 0,09 |
| 693 | Skyworks Solutions Inc* | 77.907 | 0,14 |
| 668 | Snap-on Inc* | 192.945 | 0,35 |
| 1.082 | Starbucks Corp* | 103.883 | 0,19 |
| 851 | Steel Dynamics Inc* | 100.503 | 0,18 |
| 1.416 | TE Connectivity Ltd* | 198.948 | 0,36 |
| 1.238 | Texas Instruments Inc* | 211.030 | 0,38 |
| 3.730 | TJX Cos Inc* | 349.911 | 0,63 |
| 266 | Trane Technologies Plc* | 64.878 | 0,12 |
| 1.626 | Travelers Cos Inc* | 309.737 | 0,56 |
| 275 | Union Pacific Corp* | 67.546 | 0,12 |
| 258 | United Rentals Inc* | 147.942 | 0,27 |
| 626 | UnitedHealth Group Inc* | 329.570 | 0,59 |

Global Sustainable Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|-----------------------------|-------------------|------------------------------|
| Aktien 97,01 % (31. Dezember 2022: 97,79 %) (Fortsetzung) | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | |
| 6.340 | Verizon Communications Inc* | 239.018 | 0,43 |
| 755 | Visa Inc Class A* | 196.564 | 0,35 |
| 269 | Walmart Inc* | 42.408 | 0,08 |
| 1.064 | Wells Fargo & Co* | 52.370 | 0,09 |
| 2.821 | Williams Cos Inc* | 98.255 | 0,18 |
| 148 | WW Grainger Inc* | 122.646 | 0,22 |
| 2.276 | Yum China Holdings Inc* | 96.571 | 0,17 |
| 844 | Yum! Brands Inc* | 110.277 | 0,20 |
| US-Dollar insgesamt | | 32.644.183 | 58,84 |
| Aktien insgesamt | | 53.809.071 | 97,01 |
| Immobilienaktiengesellschaften 2,02 % (31. Dezember 2022: 1,57 %) | | | |
| Australischer Dollar | | | |
| 16.548 | Stockland | 50.247 | 0,09 |
| Australischer Dollar insgesamt | | 50.247 | 0,09 |
| Euro | | | |
| 2.396 | Klepierre SA | 65.321 | 0,12 |
| Euro insgesamt | | 65.321 | 0,12 |
| Britisches Pfund | | | |
| 2.425 | Land Securities Group Plc | 21.788 | 0,04 |
| Britisches Pfund insgesamt | | 21.788 | 0,04 |
| US-Dollar | | | |
| 213 | Essex Property Trust Inc | 52.811 | 0,10 |
| 8.055 | Host Hotels & Resorts Inc | 156.831 | 0,28 |
| 1.699 | Regency Centers Corp | 113.833 | 0,21 |
| 4.596 | Simon Property Group Inc | 655.573 | 1,18 |
| US-Dollar insgesamt | | 979.048 | 1,77 |
| Immobilienaktiengesellschaften insgesamt * | | 1.116.404 | 2,02 |
| Anlagen insgesamt | | 54.925.475 | 99,03 |

Global Sustainable Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 0,12 % (31. Dezember 2022: 0,26 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 23.730 € | 25.719 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 4 | 512 | 0,00 |
| 841.176 € | 897.010 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 9 | 32.773 | 0,06 |
| 823.668 € | 877.268 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 15 | 33.163 | 0,06 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | 66.448 | 0,12 |
| | | | | | Zeitwert % des Netto- | |
| | | | | | US\$ vermögens | |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | | | | | 54.991.923 | 99,15 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,08 %) (31. Dezember 2022: (0,19 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 5.120 € | 5.673 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (14) | (0,00) |
| 14.290 US\$ | 13.339 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | (454) | (0,00) |
| 600.291 US\$ | 563.223 € | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | (22.261) | (0,04) |
| 633.853 US\$ | 595.312 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 11 | (24.168) | (0,04) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | (46.897) | (0,08) |
| | | | | | Zeitwert | % des |
| | | | | | US\$ | Netto- |
| | | | | | vermögens | |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | | | | | (46.897) | (0,08) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | | | | | 54.945.026 | 99,07 |
| Sonstiges Nettovermögen | | | | | 520.868 | 0,93 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | | | | | 55.465.894 | 100,00 |

| Portfolioanalyse | US\$ | % des Gesamtvermögens |
|---|-------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 53.868.784 | 96,81 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 1.056.691 | 1,90 |
| [∞] OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente | 19.551 | 0,04 |
| Anlagen insgesamt | 54.945.026 | 98,75 |

High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|---|--|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 0,49 % (31. Dezember 2022: 0,95 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 1.000.000 | AB BSL CLO 3 Ltd Series 2021-3X Class E | 12,53 % | 20.10.2034 | 962.016 | 0,04 |
| 4.000.000 | AB BSL CLO 4 Ltd Series 2023-4X Class D | 10,82 % | 20.04.2036 | 4.019.966 | 0,18 |
| 1.400.000 | Aimco CDO Series 2020-12X Class ER | 11,42 % | 17.01.2032 | 1.371.150 | 0,06 |
| 2.000.000 | Ocean Trails CLO XIV Ltd Series 2023-14X Class D | 11,14 % | 20.01.2035 | 1.988.987 | 0,09 |
| 2.500.000 | Trinitas CLO XXI Ltd Series 2022-21X Class D | 11,64 % | 20.01.2036 | 2.555.863 | 0,12 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt ** | | | | 10.897.982 | 0,49 |
| Unternehmensanleihen 88,78 % (31. Dezember 2022: 86,24 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 1.995.000 | 1011778 BC ULC/New Red Finance Inc** | 3,50 % | 15.02.2029 | 1.841.529 | 0,08 |
| 4.105.000 | 1011778 BC ULC/New Red Finance Inc** | 3,88 % | 15.01.2028 | 3.881.065 | 0,17 |
| 2.740.000 | 1011778 BC ULC/New Red Finance Inc** | 4,00 % | 15.10.2030 | 2.460.873 | 0,11 |
| 4.235.000 | 180 Medical Inc** | 3,88 % | 15.10.2029 | 3.819.229 | 0,17 |
| 1.690.000 | Acushnet Co** | 7,38 % | 15.10.2028 | 1.764.216 | 0,08 |
| 2.000.000 | Adient Global Holdings Ltd** | 8,25 % | 15.04.2031 | 2.119.388 | 0,09 |
| 2.730.000 | ADT Security Corp** | 4,13 % | 01.08.2029 | 2.515.286 | 0,11 |
| 2.055.000 | ADT Security Corp** | 4,88 % | 15.07.2032 | 1.903.125 | 0,08 |
| 2.680.000 | Advanced Drainage Systems Inc** | 6,38 % | 15.06.2030 | 2.701.798 | 0,12 |
| 2.334.000 | AerCap Global Aviation Trust* | 6,50 % | 15.06.2045 | 2.340.278 | 0,10 |
| 6.620.000 | Ahead DB Holdings LLC** | 6,63 % | 01.05.2028 | 5.774.328 | 0,26 |
| 6.335.000 | Ahlstrom Holding 3 Oy* | 4,88 % | 04.02.2028 | 5.562.157 | 0,25 |
| 3.410.000 | Air Canada** | 3,88 % | 15.08.2026 | 3.260.028 | 0,14 |
| 380.000 | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC** | 3,25 % | 15.03.2026 | 358.770 | 0,02 |
| 2.820.000 | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC** | 3,50 % | 15.03.2029 | 2.563.809 | 0,11 |
| 6.935.000 | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC** | 4,88 % | 15.02.2030 | 6.646.620 | 0,30 |
| 990.000 | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC** | 5,88 % | 15.02.2028 | 991.283 | 0,04 |
| 7.245.000 | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC** | 6,50 % | 15.02.2028 | 7.336.091 | 0,33 |
| 10.023.000 | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer** | 6,75 % | 15.10.2027 | 9.997.942 | 0,44 |
| 4.560.000 | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer** | 6,75 % | 15.04.2028 | 4.667.867 | 0,21 |
| 2.740.000 | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer** | 7,00 % | 15.01.2031 | 2.892.043 | 0,13 |
| 7.145.000 | Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp** | 6,00 % | 01.06.2029 | 5.832.457 | 0,26 |
| 3.445.000 | Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp** | 6,63 % | 15.07.2026 | 3.430.148 | 0,15 |
| 3.165.000 | Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl** | 4,63 % | 01.06.2028 | 2.880.898 | 0,13 |
| 5.230.000 | Allwyn Entertainment Financing UK Plc** | 7,88 % | 30.04.2029 | 5.347.675 | 0,24 |
| 1.295.000 | Ally Financial Inc* | 5,75 % | 20.11.2025 | 1.287.920 | 0,06 |
| 2.085.000 | Ally Financial Inc* | 5,80 % | 01.05.2025 | 2.088.612 | 0,09 |
| 2.070.000 | Altice Financing SA** | 5,00 % | 15.01.2028 | 1.878.031 | 0,08 |
| 4.705.000 | Altice Financing SA** | 5,75 % | 15.08.2029 | 4.181.538 | 0,19 |
| 8.810.000 | Altice France Holding SA** | 6,00 % | 15.02.2028 | 4.239.410 | 0,19 |

High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 88,78 % (31. Dezember 2022: 86,24 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 8.280.000 | Altice France SA [*] | 5,50 % | 15.01.2028 | 6.825.743 | 0,30 |
| 4.320.000 | Altice France SA ^{**} | 5,50 % | 15.10.2029 | 3.392.861 | 0,15 |
| 2.540.000 | American Airlines Inc ^{**} | 7,25 % | 15.02.2028 | 2.571.356 | 0,11 |
| 11.808.334 | American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd ^{**} | 5,50 % | 20.04.2026 | 11.731.833 | 0,52 |
| 15.240.000 | American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd ^{**} | 5,75 % | 20.04.2029 | 14.872.829 | 0,66 |
| 2.675.000 | Amkor Technology Inc ^{**} | 6,63 % | 15.09.2027 | 2.710.778 | 0,12 |
| 1.301.000 | Amsted Industries Inc ^{**} | 5,63 % | 01.07.2027 | 1.297.634 | 0,06 |
| 2.605.000 | Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp ^{**} | 5,38 % | 15.06.2029 | 2.507.452 | 0,11 |
| 3.675.000 | Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp ^{**} | 5,75 % | 01.03.2027 | 3.648.767 | 0,16 |
| 2.985.000 | APi Group DE Inc ^{**} | 4,13 % | 15.07.2029 | 2.736.831 | 0,12 |
| 885.000 | APi Group DE Inc ^{**} | 4,75 % | 15.10.2029 | 832.289 | 0,04 |
| 9.655.000 | APX Group Inc ^{**} | 5,75 % | 15.07.2029 | 9.013.316 | 0,40 |
| 605.000 | APX Group Inc ^{**} | 6,75 % | 15.02.2027 | 604.341 | 0,03 |
| 4.790.000 | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc ^{**} | 4,00 % | 01.09.2029 | 4.060.658 | 0,18 |
| 1.430.000 | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc ^{**} | 6,00 % | 15.06.2027 | 1.425.771 | 0,06 |
| 5.735.000 | Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc ^{**} | 5,25 % | 15.08.2027 | 4.462.058 | 0,20 |
| 4.095.000 | Arsenal AIC Parent LLC ^{**} | 8,00 % | 01.10.2030 | 4.277.678 | 0,19 |
| 2.690.000 | Asbury Automotive Group Inc ^{**} | 4,63 % | 15.11.2029 | 2.492.879 | 0,11 |
| 9.455.000 | Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp ^{**} | 5,88 % | 30.06.2029 | 8.806.654 | 0,39 |
| 3.430.000 | Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp ^{**} | 7,00 % | 01.11.2026 | 3.456.905 | 0,15 |
| 5.185.000 | Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp ^{**} | 8,25 % | 31.12.2028 | 5.221.196 | 0,23 |
| 6.309.000 | ASGN Inc ^{**} | 4,63 % | 15.05.2028 | 5.997.506 | 0,27 |
| 4.832.000 | Ashland Inc ^{**} | 3,38 % | 01.09.2031 | 4.173.509 | 0,19 |
| 5.024.000 | AssuredPartners Inc ^{**} | 5,63 % | 15.01.2029 | 4.695.723 | 0,21 |
| 2.150.000 | AssuredPartners Inc ^{**} | 7,00 % | 15.08.2025 | 2.155.930 | 0,10 |
| 10.210.000 | AthenaHealth Group Inc ^{**} | 6,50 % | 15.02.2030 | 9.275.913 | 0,41 |
| 1.174.000 | ATI Inc [*] | 4,88 % | 01.10.2029 | 1.095.830 | 0,05 |
| 2.405.000 | ATI Inc [*] | 5,88 % | 01.12.2027 | 2.372.926 | 0,11 |
| 3.295.000 | ATI Inc [*] | 7,25 % | 15.08.2030 | 3.432.143 | 0,15 |
| 2.870.000 | ATS Corp ^{**} | 4,13 % | 15.12.2028 | 2.641.636 | 0,12 |
| 6.690.000 | Avient Corp ^{**} | 7,13 % | 01.08.2030 | 6.963.614 | 0,31 |
| 3.525.000 | Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance Inc ^{**} | 8,00 % | 15.02.2031 | 3.523.184 | 0,16 |
| 5.470.000 | Avolon Holdings Funding Ltd ^{**} | 6,38 % | 04.05.2028 | 5.582.358 | 0,25 |
| 3.460.000 | Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV ^{**} | 7,25 % | 15.02.2031 | 3.632.941 | 0,16 |
| 400.000 | Ball Corp [*] | 5,25 % | 01.07.2025 | 399.766 | 0,02 |
| 2.855.000 | Ball Corp [*] | 6,00 % | 15.06.2029 | 2.919.018 | 0,13 |
| 415.000 | Ball Corp ^{**} | 6,88 % | 15.03.2028 | 431.420 | 0,02 |
| 5.110.000 | Banijay Entertainment SASU ^{**} | 8,13 % | 01.05.2029 | 5.265.932 | 0,23 |
| 3.230.000 | Bank of New York Mellon Corp ^{**} | 3,70 % | 29.12.2049 | 3.037.686 | 0,14 |

High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---------------------------------|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 88,78 % (31. Dezember 2022: 86,24 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 5.900.000 | Bath & Body Works Inc** | 6,63 % | 01.10.2030 | 6.033.883 | 0,27 |
| 3.235.000 | Bausch & Lomb Escrow Corp** | 8,38 % | 01.10.2028 | 3.416.775 | 0,15 |
| 3.150.000 | Bausch Health Cos Inc** | 5,50 % | 01.11.2025 | 2.884.439 | 0,13 |
| 1.015.000 | Bausch Health Cos Inc** | 5,75 % | 15.08.2027 | 655.807 | 0,03 |
| 1.705.000 | Bausch Health Cos Inc** | 6,13 % | 01.02.2027 | 1.152.682 | 0,05 |
| 1.660.000 | Bausch Health Cos Inc** | 9,00 % | 15.12.2025 | 1.552.897 | 0,07 |
| 5.980.000 | BCPE Empire Holdings Inc** | 7,63 % | 01.05.2027 | 5.772.500 | 0,26 |
| 4.550.000 | Beacon Roofing Supply Inc** | 6,50 % | 01.08.2030 | 4.655.728 | 0,21 |
| 5.580.000 | Benteler International AG** | 10,50 % | 15.05.2028 | 5.882.576 | 0,26 |
| 3.435.000 | Berry Global Inc** | 5,63 % | 15.07.2027 | 3.412.829 | 0,15 |
| 2.600.000 | Blackstone Mortgage Trust Inc** | 3,75 % | 15.01.2027 | 2.314.851 | 0,10 |
| 1.665.000 | Bombardier Inc** | 6,00 % | 15.02.2028 | 1.624.175 | 0,07 |
| 3.007.000 | Bombardier Inc** | 7,88 % | 15.04.2027 | 3.010.371 | 0,13 |
| 1.545.000 | Bombardier Inc** | 8,75 % | 15.11.2030 | 1.646.897 | 0,07 |
| 3.515.000 | Borr IHC Ltd/Borr Finance LLC** | 10,00 % | 15.11.2028 | 3.673.175 | 0,16 |
| 3.380.000 | Borr IHC Ltd/Borr Finance LLC** | 10,38 % | 15.11.2030 | 3.498.300 | 0,16 |
| 2.690.000 | BroadStreet Partners Inc** | 5,88 % | 15.04.2029 | 2.513.224 | 0,11 |
| 3.610.000 | Buckeye Partners LP** | 4,50 % | 01.03.2028 | 3.404.389 | 0,15 |
| 4.851.000 | Buckeye Partners LP** | 5,85 % | 15.11.2043 | 3.937.363 | 0,18 |
| 1.980.000 | Builders FirstSource Inc** | 5,00 % | 01.03.2030 | 1.914.124 | 0,09 |
| 5.350.000 | Builders FirstSource Inc** | 6,38 % | 15.06.2032 | 5.468.957 | 0,24 |
| 5.250.000 | Cable One Inc** | 4,00 % | 15.11.2030 | 4.257.137 | 0,19 |
| 3.750.000 | Caesars Entertainment Inc** | 6,25 % | 01.07.2025 | 3.763.027 | 0,17 |
| 4.540.000 | Caesars Entertainment Inc** | 8,13 % | 01.07.2027 | 4.657.059 | 0,21 |
| 6.640.000 | Calderys Financing LLC** | 11,25 % | 01.06.2028 | 6.962.973 | 0,31 |
| 2.035.000 | Callon Petroleum Co** | 7,50 % | 15.06.2030 | 2.054.497 | 0,09 |
| 2.299.000 | Calpine Corp** | 4,63 % | 01.02.2029 | 2.137.602 | 0,10 |
| 4.837.000 | Calpine Corp** | 5,00 % | 01.02.2031 | 4.440.491 | 0,20 |
| 85.000 | Calpine Corp** | 5,13 % | 15.03.2028 | 81.549 | 0,00 |
| 1.900.000 | Calpine Corp** | 5,25 % | 01.06.2026 | 1.875.947 | 0,08 |
| 11.085.000 | Camelot Return Merger Sub Inc** | 8,75 % | 01.08.2028 | 11.265.953 | 0,50 |
| 1.165.000 | Carnival Corp** | 5,75 % | 01.03.2027 | 1.137.254 | 0,05 |
| 2.635.000 | Carnival Corp** | 7,00 % | 15.08.2029 | 2.752.903 | 0,12 |
| 6.645.000 | Carnival Corp** | 7,63 % | 01.03.2026 | 6.769.301 | 0,30 |
| 2.775.000 | Carnival Corp** | 9,88 % | 01.08.2027 | 2.915.074 | 0,13 |
| 12.730.000 | Carnival Holdings Bermuda Ltd** | 10,38 % | 01.05.2028 | 13.865.440 | 0,62 |
| 2.180.000 | Carnival Plc* | 7,88 % | 01.06.2027 | 2.283.583 | 0,10 |
| 28.000 | Carpenter Technology Corp* | 6,38 % | 15.07.2028 | 27.928 | 0,00 |
| 4.375.000 | Carpenter Technology Corp* | 7,63 % | 15.03.2030 | 4.517.541 | 0,20 |
| 5.285.000 | Catalent Pharma Solutions Inc** | 3,13 % | 15.02.2029 | 4.630.981 | 0,21 |

High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 88,78 % (31. Dezember 2022: 86,24 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 1.345.000 | Catalent Pharma Solutions Inc** | 3,50 % | 01.04.2030 | 1.171.533 | 0,05 |
| 3.290.000 | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp** | 4,25 % | 01.02.2031 | 2.879.590 | 0,13 |
| 3.160.000 | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp** | 4,25 % | 15.01.2034 | 2.572.136 | 0,11 |
| 2.015.000 | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp** | 4,50 % | 15.08.2030 | 1.819.181 | 0,08 |
| 5.000.000 | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp** | 4,50 % | 01.05.2032 | 4.288.947 | 0,19 |
| 5.545.000 | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp** | 4,75 % | 01.03.2030 | 5.074.783 | 0,23 |
| 2.330.000 | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp** | 4,75 % | 01.02.2032 | 2.057.623 | 0,09 |
| 13.810.000 | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp** | 5,00 % | 01.02.2028 | 13.223.940 | 0,59 |
| 1.120.000 | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp** | 5,13 % | 01.05.2027 | 1.082.810 | 0,05 |
| 4.375.000 | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp** | 6,38 % | 01.09.2029 | 4.320.281 | 0,19 |
| 1.900.000 | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp** | 7,38 % | 01.03.2031 | 1.951.279 | 0,09 |
| 2.580.000 | Cedar Fair LP** | 5,25 % | 15.07.2029 | 2.436.965 | 0,11 |
| 945.000 | Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op** | 5,50 % | 01.05.2025 | 940.840 | 0,04 |
| 3.315.000 | Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op** | 6,50 % | 01.10.2028 | 3.294.835 | 0,15 |
| 1.045.000 | Central Parent Inc/CDK Global Inc** | 7,25 % | 15.06.2029 | 1.066.520 | 0,05 |
| 1.185.000 | Central Parent LLC/CDK Global II LLC/CDK Financing Co Inc** | 8,00 % | 15.06.2029 | 1.237.768 | 0,06 |
| 10.210.000 | Chart Industries Inc** | 7,50 % | 01.01.2030 | 10.684.734 | 0,47 |
| 2.720.000 | Chesapeake Energy Corp** | 6,75 % | 15.04.2029 | 2.748.215 | 0,12 |
| 5.345.000 | CHS/Community Health Systems Inc** | 5,25 % | 15.05.2030 | 4.477.648 | 0,20 |
| 3.045.000 | CHS/Community Health Systems Inc** | 5,63 % | 15.03.2027 | 2.833.198 | 0,13 |
| 1.555.000 | CHS/Community Health Systems Inc** | 6,00 % | 15.01.2029 | 1.401.475 | 0,06 |
| 2.695.000 | CHS/Community Health Systems Inc** | 10,88 % | 15.01.2032 | 2.819.994 | 0,13 |
| 2.395.000 | Churchill Downs Inc** | 4,75 % | 15.01.2028 | 2.296.855 | 0,10 |
| 1.215.000 | Churchill Downs Inc** | 5,50 % | 01.04.2027 | 1.203.184 | 0,05 |
| 8.590.000 | Churchill Downs Inc** | 6,75 % | 01.05.2031 | 8.729.033 | 0,39 |
| 3.160.000 | Ciena Corp** | 4,00 % | 31.01.2030 | 2.881.462 | 0,13 |
| 5.520.000 | Civitas Resources Inc** | 8,38 % | 01.07.2028 | 5.769.476 | 0,26 |
| 12.165.000 | Civitas Resources Inc** | 8,63 % | 01.11.2030 | 12.913.963 | 0,57 |
| 5.360.000 | Civitas Resources Inc** | 8,75 % | 01.07.2031 | 5.712.672 | 0,25 |
| 1.115.000 | Clearway Energy Operating LLC** | 3,75 % | 15.01.2032 | 972.676 | 0,04 |
| 3.865.000 | CommScope Inc** | 4,75 % | 01.09.2029 | 2.598.616 | 0,12 |
| 3.465.000 | CommScope Inc** | 8,25 % | 01.03.2027 | 1.832.673 | 0,08 |
| 7.487.000 | CommScope Technologies LLC** | 5,00 % | 15.03.2027 | 3.123.464 | 0,14 |
| 7.875.000 | Comstock Resources Inc** | 5,88 % | 15.01.2030 | 6.840.583 | 0,30 |
| 8.169.000 | Comstock Resources Inc** | 6,75 % | 01.03.2029 | 7.480.943 | 0,33 |
| 2.620.000 | Consensus Cloud Solutions Inc** | 6,50 % | 15.10.2028 | 2.379.185 | 0,11 |
| 4.070.000 | Cornerstone Building Brands Inc** | 6,13 % | 15.01.2029 | 3.341.572 | 0,15 |
| 6.220.000 | Coty Inc** | 5,00 % | 15.04.2026 | 6.125.624 | 0,27 |
| 2.195.000 | Coty Inc/HFC Prestige Products Inc/HFC Prestige International US LLC** | 4,75 % | 15.01.2029 | 2.095.424 | 0,09 |
| 5.970.000 | Coty Inc/HFC Prestige Products Inc/HFC Prestige International US LLC** | 6,63 % | 15.07.2030 | 6.136.773 | 0,27 |

High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 88,78 % (31. Dezember 2022: 86,24 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 11.190.000 | CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC** | 5,50 % | 15.06.2031 | 10.619.415 | 0,47 |
| 3.420.000 | CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC** | 7,50 % | 15.12.2033 | 3.548.377 | 0,16 |
| 1.770.000 | Crown Americas LLC/Crown Americas Capital Corp VI** | 4,75 % | 01.02.2026 | 1.754.303 | 0,08 |
| 6.330.000 | CSC Holdings LLC** | 4,13 % | 01.12.2030 | 4.822.954 | 0,21 |
| 4.795.000 | CSC Holdings LLC** | 4,63 % | 01.12.2030 | 2.893.161 | 0,13 |
| 4.305.000 | CSC Holdings LLC** | 5,00 % | 15.11.2031 | 2.609.347 | 0,12 |
| 5.290.000 | CSC Holdings LLC** | 5,25 % | 01.06.2024 | 5.182.301 | 0,23 |
| 3.905.000 | CSC Holdings LLC** | 5,38 % | 01.02.2028 | 3.453.087 | 0,15 |
| 14.630.000 | CSC Holdings LLC** | 5,75 % | 15.01.2030 | 9.122.390 | 0,41 |
| 2.525.000 | CSC Holdings LLC** | 11,25 % | 15.05.2028 | 2.603.439 | 0,12 |
| 6.550.000 | Cushman & Wakefield US Borrower LLC** | 8,88 % | 01.09.2031 | 6.946.439 | 0,31 |
| 6.695.000 | Dana Inc* | 4,50 % | 15.02.2032 | 5.832.648 | 0,26 |
| 3.390.000 | Dana Inc* | 5,38 % | 15.11.2027 | 3.369.660 | 0,15 |
| 720.000 | Dana Inc* | 5,63 % | 15.06.2028 | 710.517 | 0,03 |
| 1.095.000 | Darling Ingredients Inc** | 6,00 % | 15.06.2030 | 1.096.544 | 0,05 |
| 1.470.000 | DaVita Inc** | 3,75 % | 15.02.2031 | 1.209.634 | 0,05 |
| 1.755.000 | DaVita Inc** | 4,63 % | 01.06.2030 | 1.533.650 | 0,07 |
| 5.325.000 | Dealer Tire LLC/DT Issuer LLC** | 8,00 % | 01.02.2028 | 5.277.954 | 0,23 |
| 3.655.000 | Diamond Foreign Asset Co/Diamond Finance LLC** | 8,50 % | 01.10.2030 | 3.740.699 | 0,17 |
| 6.175.000 | Diamond Sports Group LLC/Diamond Sports Finance Co** | 5,38 % | 15.08.2026 | 316.469 | 0,01 |
| 7.170.000 | DISH DBS Corp** | 5,13 % | 01.06.2029 | 3.702.767 | 0,16 |
| 2.665.000 | DISH DBS Corp** | 5,25 % | 01.12.2026 | 2.288.236 | 0,10 |
| 1.865.000 | DISH DBS Corp** | 7,75 % | 01.07.2026 | 1.300.912 | 0,06 |
| 5.240.000 | DISH Network Corp** | 3,38 % | 15.08.2026 | 2.803.400 | 0,12 |
| 3.520.000 | DISH Network Corp** | 11,75 % | 15.11.2027 | 3.677.245 | 0,16 |
| 8.120.000 | DT Midstream Inc** | 4,13 % | 15.06.2029 | 7.479.847 | 0,33 |
| 4.820.000 | Emerald Debt Merger Sub LLC** | 6,63 % | 15.12.2030 | 4.929.028 | 0,22 |
| 2.538.000 | Encompass Health Corp* | 4,50 % | 01.02.2028 | 2.430.640 | 0,11 |
| 2.340.000 | Encompass Health Corp* | 4,63 % | 01.04.2031 | 2.155.991 | 0,10 |
| 9.980.000 | Energizer Holdings Inc** | 6,50 % | 31.12.2027 | 9.990.289 | 0,44 |
| 515.000 | Energy Transfer LP* | 5,75 % | 01.04.2025 | 515.528 | 0,02 |
| 4.974.000 | Energy Transfer LP** | 6,00 % | 01.02.2029 | 5.021.943 | 0,22 |
| 525.000 | Energy Transfer LP** | 7,38 % | 01.02.2031 | 552.069 | 0,02 |
| 2.055.000 | EnLink Midstream LLC** | 6,50 % | 01.09.2030 | 2.100.438 | 0,09 |
| 2.880.000 | EPR Properties* | 3,75 % | 15.08.2029 | 2.536.499 | 0,11 |
| 3.590.000 | EQM Midstream Partners LP* | 4,13 % | 01.12.2026 | 3.470.629 | 0,15 |
| 2.570.000 | EQM Midstream Partners LP** | 4,50 % | 15.01.2029 | 2.430.285 | 0,11 |
| 1.577.000 | EQM Midstream Partners LP** | 6,00 % | 01.07.2025 | 1.577.261 | 0,07 |
| 3.580.000 | EQM Midstream Partners LP** | 6,50 % | 01.07.2027 | 3.647.508 | 0,16 |
| 1.630.000 | EQM Midstream Partners LP** | 7,50 % | 01.06.2027 | 1.680.566 | 0,07 |

High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 88,78 % (31. Dezember 2022: 86,24 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 2.310.000 | EQM Midstream Partners LP** | 7,50 % | 01.06.2030 | 2.485.927 | 0,11 |
| 13.445.000 | EquipmentShare.com Inc** | 9,00 % | 15.05.2028 | 13.849.694 | 0,62 |
| 4.689.000 | Everi Holdings Inc** | 5,00 % | 15.07.2029 | 4.262.095 | 0,19 |
| 1.745.000 | Fair Isaac Corp** | 5,25 % | 15.05.2026 | 1.734.111 | 0,08 |
| 1.365.000 | First Quantum Minerals Ltd** | 6,88 % | 01.03.2026 | 1.223.648 | 0,05 |
| 1.300.000 | First Quantum Minerals Ltd** | 6,88 % | 15.10.2027 | 1.106.625 | 0,05 |
| 913.000 | First Quantum Minerals Ltd** | 7,50 % | 01.04.2025 | 871.372 | 0,04 |
| 3.650.000 | First Quantum Minerals Ltd** | 8,63 % | 01.06.2031 | 3.097.937 | 0,14 |
| 2.780.000 | FMG Resources August 2006 Pty Ltd** | 4,38 % | 01.04.2031 | 2.546.741 | 0,11 |
| 1.145.000 | FMG Resources August 2006 Pty Ltd** | 6,13 % | 15.04.2032 | 1.154.840 | 0,05 |
| 3.260.000 | Foot Locker Inc** | 4,00 % | 01.10.2029 | 2.701.741 | 0,12 |
| 2.380.000 | Ford Motor Co* | 6,10 % | 19.08.2032 | 2.400.299 | 0,11 |
| 1.975.000 | Ford Motor Co* | 9,63 % | 22.04.2030 | 2.329.183 | 0,10 |
| 1.370.000 | Ford Motor Credit Co LLC* | 3,63 % | 17.06.2031 | 1.182.116 | 0,05 |
| 2.480.000 | Ford Motor Credit Co LLC* | 4,13 % | 17.08.2027 | 2.349.934 | 0,10 |
| 2.385.000 | Ford Motor Credit Co LLC* | 5,11 % | 03.05.2029 | 2.321.438 | 0,10 |
| 1.685.000 | Ford Motor Credit Co LLC* | 6,80 % | 12.05.2028 | 1.761.124 | 0,08 |
| 1.650.000 | Ford Motor Credit Co LLC* | 7,20 % | 10.06.2030 | 1.759.140 | 0,08 |
| 2.350.000 | Ford Motor Credit Co LLC* | 7,35 % | 04.11.2027 | 2.479.798 | 0,11 |
| 4.055.000 | Ford Motor Credit Co LLC** | 8,37 % | 06.03.2026 | 4.165.615 | 0,19 |
| 1.385.000 | Fortrea Holdings Inc** | 7,50 % | 01.07.2030 | 1.424.088 | 0,06 |
| 2.925.000 | Frontier Communications Holdings LLC** | 5,00 % | 01.05.2028 | 2.705.908 | 0,12 |
| 6.500.000 | Frontier Communications Holdings LLC** | 5,88 % | 01.11.2029 | 5.499.837 | 0,24 |
| 2.705.000 | Frontier Communications Holdings LLC** | 8,75 % | 15.05.2030 | 2.784.821 | 0,12 |
| 2.795.000 | Gap Inc** | 3,63 % | 01.10.2029 | 2.393.149 | 0,11 |
| 2.730.000 | Garda World Security Corp** | 6,00 % | 01.06.2029 | 2.450.046 | 0,11 |
| 1.260.000 | Garda World Security Corp** | 7,75 % | 15.02.2028 | 1.304.893 | 0,06 |
| 2.850.000 | Gen Digital Inc** | 6,75 % | 30.09.2027 | 2.901.169 | 0,13 |
| 3.910.000 | Gen Digital Inc** | 7,13 % | 30.09.2030 | 4.090.407 | 0,18 |
| 800.000 | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp* | 6,25 % | 15.05.2026 | 799.809 | 0,04 |
| 3.160.000 | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp* | 7,75 % | 01.02.2028 | 3.174.271 | 0,14 |
| 3.915.000 | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp* | 8,25 % | 15.01.2029 | 4.031.824 | 0,18 |
| 2.650.000 | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp* | 8,88 % | 15.04.2030 | 2.743.026 | 0,12 |
| 585.000 | GFL Environmental Inc** | 3,50 % | 01.09.2028 | 541.158 | 0,02 |
| 385.000 | GFL Environmental Inc** | 3,75 % | 01.08.2025 | 376.234 | 0,02 |
| 2.520.000 | GFL Environmental Inc** | 6,75 % | 15.01.2031 | 2.599.458 | 0,12 |
| 4.256.232 | Global Aircraft Leasing Co Ltd** | 6,50 % | 15.09.2024 | 4.005.817 | 0,18 |
| 8.560.000 | Global Infrastructure Solutions Inc** | 5,63 % | 01.06.2029 | 7.827.275 | 0,35 |
| 155.000 | Global Infrastructure Solutions Inc** | 7,50 % | 15.04.2032 | 143.186 | 0,01 |
| 4.430.000 | Goodyear Tire & Rubber Co** | 5,00 % | 31.05.2026 | 4.364.566 | 0,19 |

High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 88,78 % (31. Dezember 2022: 86,24 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 1.125.000 | Goodyear Tire & Rubber Co** | 5,25 % | 30.04.2031 | 1.030.726 | 0,05 |
| 4.815.000 | Goodyear Tire & Rubber Co** | 5,25 % | 15.07.2031 | 4.374.692 | 0,19 |
| 6.325.000 | Greystar Real Estate Partners LLC** | 7,75 % | 01.09.2030 | 6.633.976 | 0,29 |
| 2.465.000 | GTCR AP Finance Inc** | 8,00 % | 15.05.2027 | 2.493.367 | 0,11 |
| 8.505.000 | GTCR W-2 Merger Sub LLC** | 7,50 % | 15.01.2031 | 8.992.951 | 0,40 |
| 4.480.000 | GYP Holdings III Corp** | 4,63 % | 01.05.2029 | 4.115.769 | 0,18 |
| 6.695.000 | Harvest Midstream I LP** | 7,50 % | 01.09.2028 | 6.662.661 | 0,30 |
| 2.097.000 | HealthEquity Inc** | 4,50 % | 01.10.2029 | 1.949.705 | 0,09 |
| 2.410.000 | Hertz Corp** | 4,63 % | 01.12.2026 | 2.162.890 | 0,10 |
| 1.470.000 | Hess Midstream Operations LP** | 5,50 % | 15.10.2030 | 1.424.405 | 0,06 |
| 1.293.000 | Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co** | 5,75 % | 01.02.2029 | 1.250.092 | 0,06 |
| 3.285.000 | Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co** | 6,00 % | 15.04.2030 | 3.190.249 | 0,14 |
| 2.195.000 | Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co** | 6,00 % | 01.02.2031 | 2.123.970 | 0,09 |
| 2.200.000 | Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co** | 6,25 % | 01.11.2028 | 2.193.966 | 0,10 |
| 3.155.000 | Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co** | 8,38 % | 01.11.2033 | 3.347.408 | 0,15 |
| 5.915.000 | Howard Midstream Energy Partners LLC** | 6,75 % | 15.01.2027 | 5.855.096 | 0,26 |
| 3.415.000 | Howard Midstream Energy Partners LLC** | 8,88 % | 15.07.2028 | 3.587.966 | 0,16 |
| 2.935.000 | HUB International Ltd** | 7,00 % | 01.05.2026 | 2.949.748 | 0,13 |
| 9.200.000 | HUB International Ltd** | 7,25 % | 15.06.2030 | 9.723.526 | 0,43 |
| 6.840.000 | Hudbay Minerals Inc** | 4,50 % | 01.04.2026 | 6.632.383 | 0,29 |
| 5.209.000 | Hudbay Minerals Inc** | 6,13 % | 01.04.2029 | 5.114.268 | 0,23 |
| 1.435.000 | IHO Verwaltungs GmbH** | 4,75 % | 15.09.2026 | 1.376.115 | 0,06 |
| 2.585.000 | IHO Verwaltungs GmbH* | 6,38 % | 15.05.2029 | 2.539.887 | 0,11 |
| 3.270.000 | Iliad Holding SASU** | 6,50 % | 15.10.2026 | 3.265.940 | 0,15 |
| 5.920.000 | Iliad Holding SASU** | 7,00 % | 15.10.2028 | 5.895.219 | 0,26 |
| 1.330.000 | Illuminate Buyer LLC/Illuminate Holdings IV Inc** | 9,00 % | 01.07.2028 | 1.273.341 | 0,06 |
| 11.520.000 | Imola Merger Corp** | 4,75 % | 15.05.2029 | 10.959.537 | 0,49 |
| 6.985.000 | INEOS Finance Plc* | 6,75 % | 15.05.2028 | 6.867.839 | 0,31 |
| 2.950.000 | INEOS Quattro Finance 2 Plc** | 9,63 % | 15.03.2029 | 3.143.848 | 0,14 |
| 3.705.000 | Intelligent Packaging Ltd Finco Inc/Intelligent Packaging Ltd Co-Issuer LLC** | 6,00 % | 15.09.2028 | 3.460.729 | 0,15 |
| 3.120.000 | International Game Technology Plc** | 4,13 % | 15.04.2026 | 3.034.373 | 0,13 |
| 610.000 | International Game Technology Plc** | 6,25 % | 15.01.2027 | 619.436 | 0,03 |
| 2.520.000 | IQVIA Inc** | 5,00 % | 15.05.2027 | 2.474.817 | 0,11 |
| 2.685.000 | Iron Mountain Inc** | 4,88 % | 15.09.2029 | 2.545.846 | 0,11 |
| 2.390.000 | Iron Mountain Inc** | 5,00 % | 15.07.2028 | 2.298.474 | 0,10 |
| 3.276.000 | Iron Mountain Inc** | 5,25 % | 15.03.2028 | 3.187.130 | 0,14 |
| 2.205.000 | Iron Mountain Inc** | 5,25 % | 15.07.2030 | 2.101.459 | 0,09 |
| 2.350.000 | Iron Mountain Inc** | 5,63 % | 15.07.2032 | 2.230.186 | 0,10 |
| 9.430.000 | ITT Holdings LLC** | 6,50 % | 01.08.2029 | 8.351.821 | 0,37 |
| 4.775.000 | Jaguar Land Rover Automotive Plc* | 5,50 % | 15.07.2029 | 4.659.017 | 0,21 |

High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 88,78 % (31. Dezember 2022: 86,24 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 2.575.000 | Jaguar Land Rover Automotive Plc* | 5,88 % | 15.01.2028 | 2.544.353 | 0,11 |
| 6.800.000 | JELD-WEN Inc** | 4,88 % | 15.12.2027 | 6.433.140 | 0,29 |
| 7.430.000 | JPMorgan Chase & Co** | 4,60 % | 29.12.2049 | 7.183.473 | 0,32 |
| 6.990.000 | KB Home** | 7,25 % | 15.07.2030 | 7.244.177 | 0,32 |
| 8.490.000 | Kinetik Holdings LP** | 5,88 % | 15.06.2030 | 8.340.338 | 0,37 |
| 5.780.000 | Knife River Corp** | 7,75 % | 01.05.2031 | 6.158.503 | 0,27 |
| 2.600.000 | Latam Airlines Group SA** | 13,38 % | 15.10.2027 | 2.908.929 | 0,13 |
| 2.910.000 | Latam Airlines Group SA** | 13,38 % | 15.10.2029 | 3.335.299 | 0,15 |
| 6.560.000 | Leeward Renewable Energy Operations LLC** | 4,25 % | 01.07.2029 | 5.722.295 | 0,25 |
| 4.630.000 | Legacy LifePoint Health LLC** | 4,38 % | 15.02.2027 | 4.279.597 | 0,19 |
| 6.775.000 | Level 3 Financing Inc** | 3,75 % | 15.07.2029 | 3.345.102 | 0,15 |
| 3.015.000 | Level 3 Financing Inc** | 3,88 % | 15.11.2029 | 2.890.589 | 0,13 |
| 6.371.000 | Level 3 Financing Inc** | 4,63 % | 15.09.2027 | 3.850.448 | 0,17 |
| 4.789.000 | Level 3 Financing Inc** | 10,50 % | 15.05.2030 | 4.575.286 | 0,20 |
| 2.570.000 | LifePoint Health Inc** | 9,88 % | 15.08.2030 | 2.600.431 | 0,12 |
| 4.470.000 | Light & Wonder International Inc** | 7,00 % | 15.05.2028 | 4.519.063 | 0,20 |
| 4.140.000 | Light & Wonder International Inc** | 7,25 % | 15.11.2029 | 4.243.045 | 0,19 |
| 3.860.000 | Light & Wonder International Inc** | 7,50 % | 01.09.2031 | 4.028.802 | 0,18 |
| 3.120.000 | Lindblad Expeditions Holdings Inc** | 9,00 % | 15.05.2028 | 3.240.011 | 0,14 |
| 100.000 | Lindblad Expeditions LLC** | 6,75 % | 15.02.2027 | 99.585 | 0,00 |
| 1.410.000 | Lions Gate Capital Holdings LLC** | 5,50 % | 15.04.2029 | 1.056.196 | 0,05 |
| 1.025.000 | Live Nation Entertainment Inc** | 3,75 % | 15.01.2028 | 958.470 | 0,04 |
| 2.780.000 | Live Nation Entertainment Inc** | 6,50 % | 15.05.2027 | 2.830.449 | 0,13 |
| 1.510.000 | LPL Holdings Inc** | 4,00 % | 15.03.2029 | 1.399.100 | 0,06 |
| 1.245.000 | LPL Holdings Inc** | 4,63 % | 15.11.2027 | 1.203.595 | 0,05 |
| 2.040.000 | Lumen Technologies Inc** | 4,00 % | 15.02.2027 | 1.318.472 | 0,06 |
| 3.915.000 | Macy's Retail Holdings LLC* | 4,50 % | 15.12.2034 | 3.177.949 | 0,14 |
| 2.505.000 | Macy's Retail Holdings LLC* | 5,13 % | 15.01.2042 | 1.957.470 | 0,09 |
| 2.535.000 | Macy's Retail Holdings LLC** | 5,88 % | 01.04.2029 | 2.436.442 | 0,11 |
| 1.880.000 | Macy's Retail Holdings LLC** | 5,88 % | 15.03.2030 | 1.788.698 | 0,08 |
| 5.680.000 | Madison IAQ LLC** | 5,88 % | 30.06.2029 | 5.011.542 | 0,22 |
| 4.421.000 | Manitowoc Co Inc** | 9,00 % | 01.04.2026 | 4.453.846 | 0,20 |
| 1.605.000 | Masonite International Corp** | 3,50 % | 15.02.2030 | 1.393.180 | 0,06 |
| 2.725.000 | Masonite International Corp** | 5,38 % | 01.02.2028 | 2.619.706 | 0,12 |
| 1.225.000 | Match Group Holdings II LLC** | 4,13 % | 01.08.2030 | 1.112.828 | 0,05 |
| 3.345.000 | Match Group Holdings II LLC** | 4,63 % | 01.06.2028 | 3.205.614 | 0,14 |
| 4.624.000 | Match Group Holdings II LLC** | 5,63 % | 15.02.2029 | 4.494.967 | 0,20 |
| 2.605.000 | Mattamy Group Corp** | 4,63 % | 01.03.2030 | 2.416.971 | 0,11 |
| 1.210.000 | Mattamy Group Corp** | 5,25 % | 15.12.2027 | 1.177.784 | 0,05 |
| 5.975.000 | Mauser Packaging Solutions Holding Co** | 7,88 % | 15.08.2026 | 6.086.021 | 0,27 |

High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 88,78 % (31. Dezember 2022: 86,24 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 11.120.000 | Mauser Packaging Solutions Holding Co** | 9,25 % | 15.04.2027 | 10.926.956 | 0,49 |
| 5.035.000 | McAfee Corp** | 7,38 % | 15.02.2030 | 4.604.943 | 0,20 |
| 2.664.000 | McGraw-Hill Education Inc** | 5,75 % | 01.08.2028 | 2.571.479 | 0,11 |
| 4.825.000 | McGraw-Hill Education Inc** | 8,00 % | 01.08.2029 | 4.491.882 | 0,20 |
| 5.365.000 | Medline Borrower LP** | 3,88 % | 01.04.2029 | 4.857.225 | 0,22 |
| 6.425.000 | Medline Borrower LP** | 5,25 % | 01.10.2029 | 6.064.663 | 0,27 |
| 1.375.000 | Meritage Homes Corp* | 5,13 % | 06.06.2027 | 1.356.413 | 0,06 |
| 1.330.000 | Merlin Entertainments Ltd** | 5,75 % | 15.06.2026 | 1.317.418 | 0,06 |
| 3.715.000 | Midcontinent Communications/Midcontinent Finance Corp** | 5,38 % | 15.08.2027 | 3.624.335 | 0,16 |
| 9.406.000 | Midwest Gaming Borrower LLC/Midwest Gaming Finance Corp** | 4,88 % | 01.05.2029 | 8.757.974 | 0,39 |
| 6.415.000 | Molina Healthcare Inc** | 3,88 % | 15.05.2032 | 5.612.508 | 0,25 |
| 3.675.000 | Molina Healthcare Inc** | 4,38 % | 15.06.2028 | 3.479.321 | 0,15 |
| 2.315.000 | Motion Bondco DAC** | 6,63 % | 15.11.2027 | 2.143.039 | 0,10 |
| 4.430.000 | MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp* | 5,00 % | 15.10.2027 | 3.622.597 | 0,16 |
| 5.250.000 | MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp* | 5,25 % | 01.08.2026 | 4.699.186 | 0,21 |
| 2.250.000 | Murphy Oil USA Inc* | 4,75 % | 15.09.2029 | 2.134.350 | 0,10 |
| 5.590.000 | Nabors Industries Inc** | 7,38 % | 15.05.2027 | 5.482.355 | 0,24 |
| 3.510.000 | Nabors Industries Inc** | 9,13 % | 31.01.2030 | 3.527.287 | 0,16 |
| 1.695.000 | Nabors Industries Ltd** | 7,25 % | 15.01.2026 | 1.630.963 | 0,07 |
| 1.745.000 | Nabors Industries Ltd** | 7,50 % | 15.01.2028 | 1.510.793 | 0,07 |
| 1.840.000 | NCL Corp Ltd** | 5,88 % | 15.03.2026 | 1.799.249 | 0,08 |
| 4.509.000 | NCL Corp Ltd** | 5,88 % | 15.02.2027 | 4.472.894 | 0,20 |
| 3.770.000 | Necessity Retail REIT Inc/American Finance Operating Partner LP** | 4,50 % | 30.09.2028 | 3.178.826 | 0,14 |
| 6.850.000 | Neptune Bidco US Inc** | 9,29 % | 15.04.2029 | 6.393.226 | 0,28 |
| 20.235.000 | New Fortress Energy Inc** | 6,50 % | 30.09.2026 | 19.452.065 | 0,86 |
| 3.220.000 | Newell Brands Inc** | 5,20 % | 01.04.2026 | 3.177.821 | 0,14 |
| 1.790.000 | Newell Brands Inc** | 6,38 % | 01.04.2036 | 1.640.322 | 0,07 |
| 8.035.000 | Newfold Digital Holdings Group Inc** | 6,00 % | 15.02.2029 | 6.078.726 | 0,27 |
| 4.090.000 | NMG Holding Co Inc/Neiman Marcus Group LLC** | 7,13 % | 01.04.2026 | 3.933.565 | 0,17 |
| 6.140.000 | Northern Oil & Gas Inc** | 8,13 % | 01.03.2028 | 6.223.136 | 0,28 |
| 355.000 | Northern Oil & Gas Inc** | 8,75 % | 15.06.2031 | 370.211 | 0,02 |
| 6.985.000 | Northwest Fiber LLC/Northwest Fiber Finance Sub Inc** | 4,75 % | 30.04.2027 | 6.676.228 | 0,30 |
| 2.547.000 | Northwest Fiber LLC/Northwest Fiber Finance Sub Inc** | 6,00 % | 15.02.2028 | 2.357.340 | 0,10 |
| 4.655.000 | NOVA Chemicals Corp** | 5,25 % | 01.06.2027 | 4.369.830 | 0,19 |
| 1.555.000 | NOVA Chemicals Corp** | 8,50 % | 15.11.2028 | 1.632.610 | 0,07 |
| 3.165.000 | Novelis Corp** | 4,75 % | 30.01.2030 | 2.981.599 | 0,13 |
| 253.000 | NRG Energy Inc** | 3,88 % | 15.02.2032 | 216.878 | 0,01 |
| 8.150.000 | NRG Energy Inc** | 5,25 % | 15.06.2029 | 7.901.562 | 0,35 |
| 8.075.000 | NRG Energy Inc** | 10,25 % | 29.12.2049 | 8.414.804 | 0,37 |
| 2.120.000 | NuStar Logistics LP* | 6,00 % | 01.06.2026 | 2.118.166 | 0,09 |

High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 88,78 % (31. Dezember 2022: 86,24 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 3.355.000 | Olympus Water US Holding Corp** | 4,25 % | 01.10.2028 | 3.022.719 | 0,13 |
| 2.770.000 | Olympus Water US Holding Corp** | 6,25 % | 01.10.2029 | 2.463.335 | 0,11 |
| 4.300.000 | Olympus Water US Holding Corp** | 9,75 % | 15.11.2028 | 4.569.365 | 0,20 |
| 1.965.000 | ON Semiconductor Corp** | 3,88 % | 01.09.2028 | 1.824.300 | 0,08 |
| 1.665.000 | OneMain Finance Corp* | 3,50 % | 15.01.2027 | 1.542.055 | 0,07 |
| 1.710.000 | OneMain Finance Corp* | 3,88 % | 15.09.2028 | 1.514.316 | 0,07 |
| 2.265.000 | OneMain Finance Corp* | 5,38 % | 15.11.2029 | 2.124.249 | 0,09 |
| 1.995.000 | OneMain Finance Corp** | 6,88 % | 15.03.2025 | 2.021.105 | 0,09 |
| 2.260.000 | OneMain Finance Corp** | 7,13 % | 15.03.2026 | 2.303.989 | 0,10 |
| 375.000 | OneMain Finance Corp* | 9,00 % | 15.01.2029 | 396.780 | 0,02 |
| 20.000 | Open Text Corp** | 3,88 % | 01.12.2029 | 17.957 | 0,00 |
| 3.020.000 | Open Text Holdings Inc** | 4,13 % | 15.02.2030 | 2.736.542 | 0,12 |
| 2.905.000 | Open Text Holdings Inc** | 4,13 % | 01.12.2031 | 2.573.284 | 0,11 |
| 360.000 | Pactiv Evergreen Group Issuer Inc/Pactiv Evergreen Group Issuer LLC** | 4,00 % | 15.10.2027 | 336.825 | 0,02 |
| 7.715.000 | Pactiv Evergreen Group Issuer LLC/Pactiv Evergreen Group Issuer Inc** | 4,38 % | 15.10.2028 | 7.220.429 | 0,32 |
| 3.595.000 | Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer** | 4,88 % | 15.05.2029 | 3.331.634 | 0,15 |
| 6.385.000 | Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer** | 5,88 % | 01.10.2028 | 6.285.364 | 0,28 |
| 2.545.000 | Penn Entertainment Inc** | 4,13 % | 01.07.2029 | 2.178.886 | 0,10 |
| 3.615.000 | Penn Entertainment Inc** | 5,63 % | 15.01.2027 | 3.507.881 | 0,16 |
| 1.490.000 | Performance Food Group Inc** | 4,25 % | 01.08.2029 | 1.368.137 | 0,06 |
| 5.641.000 | Performance Food Group Inc** | 5,50 % | 15.10.2027 | 5.564.303 | 0,25 |
| 2.048.000 | Permian Resources Operating LLC** | 5,38 % | 15.01.2026 | 2.022.540 | 0,09 |
| 5.145.000 | Permian Resources Operating LLC** | 5,88 % | 01.07.2029 | 5.022.960 | 0,22 |
| 3.100.000 | Permian Resources Operating LLC** | 7,00 % | 15.01.2032 | 3.200.495 | 0,14 |
| 2.890.000 | PetSmart Inc/PetSmart Finance Corp** | 4,75 % | 15.02.2028 | 2.726.785 | 0,12 |
| 3.395.000 | PetSmart Inc/PetSmart Finance Corp** | 7,75 % | 15.02.2029 | 3.305.535 | 0,15 |
| 3.950.000 | Pilgrim's Pride Corp** | 3,50 % | 01.03.2032 | 3.344.524 | 0,15 |
| 8.440.000 | Pilgrim's Pride Corp** | 4,25 % | 15.04.2031 | 7.633.661 | 0,34 |
| 6.945.000 | Pilgrim's Pride Corp** | 6,25 % | 01.07.2033 | 7.154.558 | 0,32 |
| 4.920.000 | Pilgrim's Pride Corp** | 6,88 % | 15.05.2034 | 5.317.698 | 0,24 |
| 3.335.000 | PNC Financial Services Group Inc** | 3,40 % | 29.12.2049 | 2.676.086 | 0,12 |
| 6.395.000 | Presidio Holdings Inc** | 8,25 % | 01.02.2028 | 6.467.276 | 0,29 |
| 7.710.000 | Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc** | 5,75 % | 15.04.2026 | 7.756.630 | 0,34 |
| 9.456.000 | Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc** | 6,25 % | 15.01.2028 | 9.408.234 | 0,42 |
| 14.365.000 | Rackspace Technology Global Inc** | 3,50 % | 15.02.2028 | 5.783.417 | 0,26 |
| 3.740.000 | Rackspace Technology Global Inc** | 5,38 % | 01.12.2028 | 1.346.755 | 0,06 |
| 3.170.000 | Radiate Holdco LLC/Radiate Finance Inc** | 6,50 % | 15.09.2028 | 1.556.373 | 0,07 |
| 4.117.000 | Raptor Acquisition Corp/Raptor Co-Issuer LLC** | 4,88 % | 01.11.2026 | 3.928.005 | 0,17 |
| 6.401.000 | Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp** | 5,25 % | 15.04.2030 | 4.785.596 | 0,21 |
| 5.305.000 | Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp** | 5,75 % | 15.01.2029 | 4.128.744 | 0,18 |

High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 88,78 % (31. Dezember 2022: 86,24 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 3.405.000 | Regal Rexnord Corp** | 6,30 % | 15.02.2030 | 3.496.300 | 0,16 |
| 2.200.000 | Regal Rexnord Corp** | 6,40 % | 15.04.2033 | 2.294.785 | 0,10 |
| 2.050.000 | RegionalCare Hospital Partners Holdings Inc/LifePoint Health Inc** | 9,75 % | 01.12.2026 | 2.036.071 | 0,09 |
| 5.670.000 | Resideo Funding Inc** | 4,00 % | 01.09.2029 | 4.954.446 | 0,22 |
| 3.323.000 | RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp** | 4,50 % | 15.02.2029 | 3.093.233 | 0,14 |
| 4.095.000 | RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp** | 7,25 % | 15.07.2028 | 4.260.076 | 0,19 |
| 2.770.000 | RingCentral Inc** | 8,50 % | 15.08.2030 | 2.835.330 | 0,13 |
| 2.490.000 | Ritchie Bros Holdings Inc** | 6,75 % | 15.03.2028 | 2.566.748 | 0,11 |
| 5.850.000 | Ritchie Bros Holdings Inc** | 7,75 % | 15.03.2031 | 6.244.056 | 0,28 |
| 6.650.000 | RLJ Lodging Trust LP** | 4,00 % | 15.09.2029 | 5.982.694 | 0,27 |
| 7.620.000 | Rockcliff Energy II LLC** | 5,50 % | 15.10.2029 | 7.211.974 | 0,32 |
| 3.025.000 | Royal Caribbean Cruises Ltd** | 4,25 % | 01.07.2026 | 2.923.659 | 0,13 |
| 8.160.000 | Royal Caribbean Cruises Ltd** | 5,50 % | 01.04.2028 | 8.061.132 | 0,36 |
| 5.625.000 | Royal Caribbean Cruises Ltd** | 9,25 % | 15.01.2029 | 6.054.064 | 0,27 |
| 8.670.000 | Scientific Games Holdings LP/Scientific Games US FinCo Inc** | 6,63 % | 01.03.2030 | 8.207.152 | 0,36 |
| 2.800.000 | SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC** | 5,38 % | 01.11.2026 | 2.691.128 | 0,12 |
| 6.915.000 | SeaWorld Parks & Entertainment Inc** | 5,25 % | 15.08.2029 | 6.472.344 | 0,29 |
| 4.555.000 | Select Medical Corp** | 6,25 % | 15.08.2026 | 4.580.708 | 0,20 |
| 5.535.000 | Sensata Technologies BV** | 4,00 % | 15.04.2029 | 5.149.903 | 0,23 |
| 400.000 | Sensata Technologies BV** | 5,00 % | 01.10.2025 | 400.733 | 0,02 |
| 1.305.000 | Sensata Technologies BV** | 5,88 % | 01.09.2030 | 1.297.929 | 0,06 |
| 2.450.000 | Service Properties Trust** | 3,95 % | 15.01.2028 | 2.010.404 | 0,09 |
| 6.035.000 | Service Properties Trust** | 8,63 % | 15.11.2031 | 6.326.267 | 0,28 |
| 4.253.000 | Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp** | 4,75 % | 15.02.2028 | 4.003.115 | 0,18 |
| 2.890.000 | Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp** | 4,75 % | 01.04.2029 | 2.673.944 | 0,12 |
| 3.595.000 | Sirius XM Radio Inc** | 3,88 % | 01.09.2031 | 3.079.949 | 0,14 |
| 1.230.000 | Sirius XM Radio Inc** | 4,00 % | 15.07.2028 | 1.138.344 | 0,05 |
| 5.260.000 | Sirius XM Radio Inc** | 4,13 % | 01.07.2030 | 4.693.984 | 0,21 |
| 4.470.000 | Sirius XM Radio Inc** | 5,50 % | 01.07.2029 | 4.326.580 | 0,19 |
| 2.470.000 | Six Flags Entertainment Corp** | 5,50 % | 15.04.2027 | 2.416.612 | 0,11 |
| 4.200.000 | Six Flags Entertainment Corp** | 7,25 % | 15.05.2031 | 4.215.666 | 0,19 |
| 1.285.000 | SNF Group SACA** | 3,13 % | 15.03.2027 | 1.170.431 | 0,05 |
| 3.150.000 | SNF Group SACA** | 3,38 % | 15.03.2030 | 2.709.763 | 0,12 |
| 7.675.000 | Solaris Midstream Holdings LLC** | 7,63 % | 01.04.2026 | 7.787.846 | 0,35 |
| 5.500.000 | SPX FLOW Inc** | 8,75 % | 01.04.2030 | 5.506.325 | 0,24 |
| 2.265.000 | SRS Distribution Inc** | 6,00 % | 01.12.2029 | 2.114.528 | 0,09 |
| 3.075.000 | SRS Distribution Inc** | 6,13 % | 01.07.2029 | 2.918.898 | 0,13 |
| 6.770.000 | Standard Industries Inc** | 4,38 % | 15.07.2030 | 6.225.578 | 0,28 |
| 3.405.000 | Star Parent Inc** | 9,00 % | 01.10.2030 | 3.592.626 | 0,16 |
| 3.655.000 | Station Casinos LLC** | 4,50 % | 15.02.2028 | 3.448.817 | 0,15 |

High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 88,78 % (31. Dezember 2022: 86,24 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 2.440.000 | Station Casinos LLC** | 4,63 % | 01.12.2031 | 2.202.550 | 0,10 |
| 2.950.000 | Summer BC Bidco B LLC** | 5,50 % | 31.10.2026 | 2.765.935 | 0,12 |
| 3.370.000 | Summit Materials LLC/Summit Materials Finance Corp** | 7,25 % | 15.01.2031 | 3.553.089 | 0,16 |
| 6.770.000 | Summit Midstream Holdings LLC/Summit Midstream Finance Corp** | 9,00 % | 15.10.2026 | 6.723.184 | 0,30 |
| 2.854.000 | Sunnova Energy Corp** | 5,88 % | 01.09.2026 | 2.432.008 | 0,11 |
| 4.820.000 | Sunnova Energy Corp** | 11,75 % | 01.10.2028 | 4.390.610 | 0,20 |
| 4.265.000 | Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp** | 5,50 % | 15.01.2028 | 4.034.918 | 0,18 |
| 1.470.000 | Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp** | 6,00 % | 01.03.2027 | 1.438.968 | 0,06 |
| 210.000 | Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp** | 6,00 % | 31.12.2030 | 195.516 | 0,01 |
| 3.460.000 | Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp** | 6,00 % | 01.09.2031 | 3.205.225 | 0,14 |
| 4.430.000 | Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp** | 7,50 % | 01.10.2025 | 4.456.779 | 0,20 |
| 2.530.000 | Taylor Morrison Communities Inc** | 5,13 % | 01.08.2030 | 2.450.242 | 0,11 |
| 6.980.000 | Team Health Holdings Inc† | 13,50 % | 30.06.2028 | 6.840.400 | 0,30 |
| 1.345.000 | TEGNA Inc** | 4,75 % | 15.03.2026 | 1.309.290 | 0,06 |
| 2.510.000 | Telecom Italia Capital SA** | 6,38 % | 15.11.2033 | 2.458.313 | 0,11 |
| 1.000.000 | Telecom Italia Capital SA** | 7,20 % | 18.07.2036 | 1.005.144 | 0,04 |
| 3.465.000 | Tenet Healthcare Corp** | 4,88 % | 01.01.2026 | 3.428.400 | 0,15 |
| 3.465.000 | Tenet Healthcare Corp** | 5,13 % | 01.11.2027 | 3.389.727 | 0,15 |
| 6.120.000 | Tenet Healthcare Corp** | 6,13 % | 01.10.2028 | 6.108.066 | 0,27 |
| 4.515.000 | Tenet Healthcare Corp** | 6,13 % | 15.06.2030 | 4.570.702 | 0,20 |
| 9.805.000 | Tenet Healthcare Corp** | 6,75 % | 15.05.2031 | 10.033.456 | 0,45 |
| 4.430.000 | Terex Corp** | 5,00 % | 15.05.2029 | 4.180.170 | 0,19 |
| 6.350.000 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV** | 7,88 % | 15.09.2029 | 6.851.720 | 0,30 |
| 1.455.000 | Thor Industries Inc** | 4,00 % | 15.10.2029 | 1.299.591 | 0,06 |
| 1.190.000 | TK Elevator Holdco GmbH** | 7,63 % | 15.07.2028 | 1.170.354 | 0,05 |
| 2.440.000 | TK Elevator US Newco Inc** | 5,25 % | 15.07.2027 | 2.398.610 | 0,11 |
| 4.483.000 | TMS International Corp** | 6,25 % | 15.04.2029 | 3.704.549 | 0,16 |
| 5.505.000 | TransAlta Corp* | 7,75 % | 15.11.2029 | 5.851.126 | 0,26 |
| 3.510.000 | TransDigm Inc* | 5,50 % | 15.11.2027 | 3.441.774 | 0,15 |
| 4.110.000 | TransDigm Inc** | 6,25 % | 15.03.2026 | 4.107.071 | 0,18 |
| 12.425.000 | TransDigm Inc** | 6,75 % | 15.08.2028 | 12.727.325 | 0,57 |
| 8.405.000 | TransDigm Inc** | 6,88 % | 15.12.2030 | 8.662.655 | 0,38 |
| 3.350.000 | TransDigm Inc* | 7,50 % | 15.03.2027 | 3.369.065 | 0,15 |
| 3.880.000 | TreeHouse Foods Inc* | 4,00 % | 01.09.2028 | 3.439.424 | 0,15 |
| 1.835.000 | Tri Pointe Homes Inc* | 5,25 % | 01.06.2027 | 1.804.970 | 0,08 |
| 4.245.000 | Trident TPI Holdings Inc** | 12,75 % | 31.12.2028 | 4.547.456 | 0,20 |
| 4.030.000 | Trivium Packaging Finance BV* | 5,50 % | 15.08.2026 | 3.958.080 | 0,18 |
| 7.410.000 | Trivium Packaging Finance BV* | 8,50 % | 15.08.2027 | 7.273.869 | 0,32 |
| 4.385.000 | Tronox Inc** | 4,63 % | 15.03.2029 | 3.887.273 | 0,17 |
| 1.510.000 | TTM Technologies Inc** | 4,00 % | 01.03.2029 | 1.373.481 | 0,06 |

High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 88,78 % (31. Dezember 2022: 86,24 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 9.580.000 | United Airlines Inc** | 4,38 % | 15.04.2026 | 9.342.323 | 0,42 |
| 4.785.000 | United Airlines Inc** | 4,63 % | 15.04.2029 | 4.480.102 | 0,20 |
| 4.680.000 | United Rentals North America Inc* | 3,75 % | 15.01.2032 | 4.146.136 | 0,18 |
| 1.430.000 | United Rentals North America Inc* | 4,00 % | 15.07.2030 | 1.318.734 | 0,06 |
| 1.195.000 | United Rentals North America Inc* | 4,88 % | 15.01.2028 | 1.167.527 | 0,05 |
| 1.905.000 | United Rentals North America Inc* | 5,25 % | 15.01.2030 | 1.877.884 | 0,08 |
| 920.000 | United States Cellular Corp* | 6,70 % | 15.12.2033 | 938.612 | 0,04 |
| 6.370.000 | Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC** | 10,50 % | 15.02.2028 | 6.463.384 | 0,29 |
| 1.235.000 | US Acute Care Solutions LLC** | 6,38 % | 01.03.2026 | 1.033.325 | 0,05 |
| 2.965.000 | US Foods Inc** | 4,63 % | 01.06.2030 | 2.765.993 | 0,12 |
| 3.620.000 | US Foods Inc** | 4,75 % | 15.02.2029 | 3.440.825 | 0,15 |
| 3.565.000 | US Foods Inc** | 6,88 % | 15.09.2028 | 3.674.127 | 0,16 |
| 3.965.000 | US Foods Inc** | 7,25 % | 15.01.2032 | 4.139.310 | 0,18 |
| 2.590.000 | USI Inc** | 7,50 % | 15.01.2032 | 2.654.879 | 0,12 |
| 3.905.000 | Venture Global Calcasieu Pass LLC** | 3,88 % | 15.08.2029 | 3.547.496 | 0,16 |
| 3.805.000 | Venture Global Calcasieu Pass LLC** | 4,13 % | 15.08.2031 | 3.357.098 | 0,15 |
| 2.500.000 | Venture Global LNG Inc** | 8,13 % | 01.06.2028 | 2.527.018 | 0,11 |
| 2.950.000 | Venture Global LNG Inc** | 8,38 % | 01.06.2031 | 2.952.913 | 0,13 |
| 5.235.000 | Venture Global LNG Inc** | 9,50 % | 01.02.2029 | 5.542.776 | 0,25 |
| 3.350.000 | Venture Global LNG Inc** | 9,88 % | 01.02.2032 | 3.491.584 | 0,16 |
| 5.580.000 | Verde Purchaser LLC** | 10,50 % | 30.11.2030 | 5.629.662 | 0,25 |
| 65.000 | Verscend Escrow Corp** | 9,75 % | 15.08.2026 | 65.497 | 0,00 |
| 1.405.000 | Viasat Inc** | 5,63 % | 15.04.2027 | 1.360.820 | 0,06 |
| 1.695.000 | Viasat Inc** | 6,50 % | 15.07.2028 | 1.393.883 | 0,06 |
| 6.715.000 | Vibrant Technologies Inc** | 9,00 % | 15.02.2030 | 5.333.195 | 0,24 |
| 7.630.000 | VICI Properties LP* | 5,13 % | 15.05.2032 | 7.446.297 | 0,33 |
| 2.740.000 | VICI Properties LP/VICI Note Co Inc** | 4,13 % | 15.08.2030 | 2.498.757 | 0,11 |
| 4.245.000 | Victoria's Secret & Co** | 4,63 % | 15.07.2029 | 3.551.245 | 0,16 |
| 3.575.000 | Viking Cruises Ltd** | 5,88 % | 15.09.2027 | 3.453.003 | 0,15 |
| 3.000.000 | Viking Cruises Ltd** | 9,13 % | 15.07.2031 | 3.198.860 | 0,14 |
| 3.620.000 | Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd** | 5,63 % | 15.02.2029 | 3.532.613 | 0,16 |
| 7.440.000 | VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc** | 6,38 % | 01.02.2030 | 5.201.912 | 0,23 |
| 6.635.000 | VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc** | 7,88 % | 01.05.2027 | 5.714.436 | 0,25 |
| 3.695.000 | VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc** | 9,50 % | 01.06.2028 | 3.131.651 | 0,14 |
| 6.705.000 | Vistra Corp** | 7,00 % | 29.12.2049 | 6.613.611 | 0,29 |
| 2.595.000 | Vistra Operations Co LLC** | 4,38 % | 01.05.2029 | 2.425.336 | 0,11 |
| 7.565.000 | Vistra Operations Co LLC** | 7,75 % | 15.10.2031 | 7.862.600 | 0,35 |
| 8.881.000 | VM Consolidated Inc** | 5,50 % | 15.04.2029 | 8.394.883 | 0,37 |
| 6.930.000 | Vmed O2 UK Financing I Plc** | 4,75 % | 15.07.2031 | 6.194.595 | 0,28 |
| 3.600.000 | White Cap Buyer LLC** | 6,88 % | 15.10.2028 | 3.489.342 | 0,16 |

High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|----------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 88,78 % (31. Dezember 2022: 86,24 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 3.575.000 | White Cap Parent LLC** | 8,25 % | 15.03.2026 | 3.563.070 | 0,16 |
| 2.495.000 | William Carter Co** | 5,63 % | 15.03.2027 | 2.465.371 | 0,11 |
| 4.615.000 | Williams Scotsman Inc** | 7,38 % | 01.10.2031 | 4.842.898 | 0,22 |
| 6.995.000 | Windsor Holdings III LLC** | 8,50 % | 15.06.2030 | 7.318.715 | 0,33 |
| 2.665.000 | WMG Acquisition Corp** | 3,75 % | 01.12.2029 | 2.429.615 | 0,11 |
| 1.540.000 | WMG Acquisition Corp** | 3,88 % | 15.07.2030 | 1.394.896 | 0,06 |
| 1.545.000 | Wolverine World Wide Inc** | 4,00 % | 15.08.2029 | 1.214.772 | 0,05 |
| 2.920.000 | WR Grace Holdings LLC** | 5,63 % | 15.08.2029 | 2.572.832 | 0,11 |
| 1.500.000 | WR Grace Holdings LLC** | 7,38 % | 01.03.2031 | 1.502.850 | 0,07 |
| 2.445.000 | Wyndham Hotels & Resorts Inc** | 4,38 % | 15.08.2028 | 2.287.971 | 0,10 |
| 2.875.000 | XHR LP** | 4,88 % | 01.06.2029 | 2.649.686 | 0,12 |
| 5.445.000 | XHR LP** | 6,38 % | 15.08.2025 | 5.436.043 | 0,24 |
| 5.110.000 | XPO Inc** | 6,25 % | 01.06.2028 | 5.180.952 | 0,23 |
| 2.240.000 | XPO Inc** | 7,13 % | 01.02.2032 | 2.313.264 | 0,10 |
| 3.710.000 | Yum! Brands Inc* | 4,63 % | 31.01.2032 | 3.473.356 | 0,15 |
| 3.530.000 | Yum! Brands Inc** | 4,75 % | 15.01.2030 | 3.425.530 | 0,15 |
| 1.555.000 | Zayo Group Holdings Inc** | 4,00 % | 01.03.2027 | 1.248.346 | 0,06 |
| 2.560.000 | ZF North America Capital Inc** | 4,75 % | 29.04.2025 | 2.532.595 | 0,11 |
| 3.530.000 | ZF North America Capital Inc** | 6,88 % | 14.04.2028 | 3.660.236 | 0,16 |
| 3.345.000 | ZF North America Capital Inc** | 7,13 % | 14.04.2030 | 3.568.978 | 0,16 |
| 8.415.000 | Ziff Davis Inc** | 4,63 % | 15.10.2030 | 7.729.558 | 0,34 |
| 3.840.000 | ZipRecruiter Inc** | 5,00 % | 15.01.2030 | 3.356.969 | 0,15 |
| 4.185.000 | ZoomInfo Technologies LLC/ZoomInfo Finance Corp** | 3,88 % | 01.02.2029 | 3.798.389 | 0,17 |
| Unternehmensanleihen insgesamt | | | | 1.999.177.351 | 88,78 |
| Staatsanleihen 1,61 % (31. Dezember 2022: 0,00 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 35.890.000 | United States Treasury Note/Bond | 5,00 % | 31.08.2025 | 36.225.768 | 1,61 |
| Staatsanleihen insgesamt * | | | | 36.225.768 | 1,61 |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen 1,91 % (31. Dezember 2022: 3,99 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 3.020.961 | Cytera DC Holdings Inc | 10,50 % | 01.05.2024 | 1.922.131 | 0,08 |
| 5.415.847 | Engineered Machinery Holdings Inc | 11,61 % | 21.05.2029 | 5.117.975 | 0,23 |
| 3.144.586 | Fleetpride Inc | 9,86 % | 29.09.2028 | 3.146.064 | 0,14 |
| 2.784.261 | Lightstone Holdco LLC B Term Loan | 11,13 % | 29.01.2027 | 2.657.230 | 0,12 |
| 157.454 | Lightstone Holdco LLC C Term Loan | 11,13 % | 29.01.2027 | 150.270 | 0,01 |
| 3.760.000 | New Fortress Energy Inc | 10,39 % | 30.10.2028 | 3.713.000 | 0,16 |
| 14.575.000 | Parexel International Inc | 11,97 % | 15.11.2029 | 14.438.359 | 0,64 |
| 4.940 | Starwood Property Mortgage LLC | 8,71 % | 26.07.2026 | 4.940 | 0,00 |

High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|-------------------------------------|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Mittelfristige Schuldverschreibungen 1,91 % (31. Dezember 2022: 3,99 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 3.004.900 | Trident TPI Holdings Inc | 9,85 % | 15.09.2028 | 3.012.412 | 0,13 |
| 5.130.706 | US Silica Co | 10,21 % | 25.03.2030 | 5.147.202 | 0,23 |
| 3.764.105 | WaterBridge Midstream Operating LLC | 11,39 % | 22.06.2026 | 3.774.475 | 0,17 |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen insgesamt † | | | | 43.084.058 | 1,91 |

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|---|-----------------------------------|----------------------|------------------------------|
| Investmentfonds 0,16 % (31. Dezember 2022: 0,80 %) | | | |
| Britisches Pfund | | | |
| 4.058.488 | NB Global Monthly Income Fund Ltd | 3.611.285 | 0,16 |
| Investmentfonds insgesamt † | | 3.611.285 | 0,16 |
| Anlagen insgesamt | | 2.092.996.444 | 92,95 |

Devisenterminkontrakte 1,81 % (31. Dezember 2022: 2,42 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeits- datum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettover- mögens |
|---------------------------------|------------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| 3.727.060 € | 4.064.787 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 54.872 | 0,00 |
| 22.020.332 £ | 26.882.994 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 1.190.987 | 0,06 |
| 2.432.381 £ | 3.081.389 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | 19.682 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> | | | | | | |
| 4.537.510 AUD | 3.011.718 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | 86.064 | 0,00 |
| 141.569.969 AUD | 91.149.395 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 40 | 5.501.163 | 0,24 |
| 117.587 US\$ | 171.483 AUD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | 514 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen CAD</i> | | | | | | |
| 398.813 CAD | 294.880 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 7 | 7.642 | 0,00 |
| 10.815.206 CAD | 7.969.319 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 4 | 234.585 | 0,01 |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> | | | | | | |
| 92.220 CHF | 106.314 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 3.435 | 0,00 |
| 254.953 CHF | 287.862 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 5 | 15.551 | 0,00 |
| 8.754.231 CHF | 9.784.013 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 7 | 634.230 | 0,03 |
| <i>Abgesicherte Klassen CNY</i> | | | | | | |
| 462.200 CNY | 64.135 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 4 | 846 | 0,00 |
| 35.484.025 CNY | 4.884.776 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 8 | 103.940 | 0,01 |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 4.712.006 € | 5.099.045 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 4 | 109.312 | 0,01 |
| 156.465.478 € | 166.777.130 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 5 | 6.170.041 | 0,27 |
| 157.875.377 € | 168.234.666 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 43 | 6.270.917 | 0,28 |
| 30.726 US\$ | 27.651 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | 163 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 1.855.500 £ | 2.344.658 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 20.941 | 0,00 |
| 259.700.344 £ | 318.921.929 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 3 | 12.173.097 | 0,54 |

High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 1,81 % (31. Dezember 2022: 2,42 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|-----------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen GBP (Fortsetzung)</i> | | | | | | |
| 16.940.740 £ | 21.134.605 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 46 | 463.344 | 0,02 |
| 130.992 US\$ | 102.630 £ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | 148 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen HKD</i> | | | | | | |
| 644.920 HKD | 82.539 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | 81 | 0,00 |
| 957.404 HKD | 122.552 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 3 | 100 | 0,00 |
| 53.021.537 HKD | 6.791.084 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | 1.449 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i> | | | | | | |
| 48.163.024 SEK | 4.438.782 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 7 | 343.363 | 0,02 |
| 1.155.016 SEK | 112.533 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | 2.149 | 0,00 |
| 491.528.732 SEK | 48.308.582 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 27 | 495.696 | 0,02 |
| 7 US\$ | 66 SEK | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | 1 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i> | | | | | | |
| 25.805.675 SGD | 18.993.752 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | 583.648 | 0,03 |
| 387.101 SGD | 290.868 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | 2.805 | 0,00 |
| 1.777.482 SGD | 1.329.005 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 10 | 19.478 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i> | | | | | | |
| 64.102 US\$ | 1.172.810 ZAR | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 4 | 56 | 0,00 |
| 2.244.887.699 ZAR | 116.419.522 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 7 | 6.172.105 | 0,27 |
| 45.725.881 ZAR | 2.487.906 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 3 | 9.151 | 0,00 |
| 18.391.800 ZAR | 986.698 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 36 | 17.667 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | 40.709.223 | 1,81 |
| | | | | | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | | | | | 2.133.705.667 | 94,76 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,69 %) (31. Dezember 2022: (1,09 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 32.239.001 US\$ | 26.404.677 £ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (1.424.632) | (0,07) |
| 3.814.559 US\$ | 3.602.175 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (167.060) | (0,01) |
| 1.121.016 US\$ | 918.143 £ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (49.536) | (0,00) |
| 145 US\$ | 200 CAD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (6) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> | | | | | | |
| 715.090 AUD | 489.510 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (1.314) | (0,00) |
| 601.110 US\$ | 945.907 AUD | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (44.666) | (0,00) |
| 401.155 US\$ | 626.952 AUD | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (26.868) | (0,00) |
| 13.047.787 US\$ | 20.177.316 AUD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 66 | (727.370) | (0,03) |

High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (0,69 %) (31. Dezember 2022: (1,09 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen CAD</i> | | | | | | |
| 45.591 US\$ | 62.631 CAD | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (1.917) | (0,00) |
| 3.794.444 US\$ | 5.149.605 CAD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | (111.801) | (0,01) |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> | | | | | | |
| 34.048 CHF | 40.562 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (43) | (0,00) |
| 50.345 US\$ | 44.794 CHF | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (2.964) | (0,00) |
| 65.482 US\$ | 58.282 CHF | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | (3.878) | (0,00) |
| 3.869.874 US\$ | 3.460.395 CHF | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 11 | (248.275) | (0,01) |
| <i>Abgesicherte Klassen CNY</i> | | | | | | |
| 69.679 CNY | 9.805 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (9) | (0,00) |
| 8.151 US\$ | 59.296 CNY | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (186) | (0,00) |
| 3.327.726 US\$ | 24.175.824 CNY | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 7 | (71.163) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 900.018 € | 997.208 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (2.385) | (0,00) |
| 93 € | 104 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (1) | (0,00) |
| 2.114.191 US\$ | 1.995.318 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (91.309) | (0,01) |
| 88.738.344 US\$ | 83.262.502 € | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (3.294.827) | (0,15) |
| 95.315.219 US\$ | 89.418.976 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 60 | (3.522.930) | (0,16) |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 209.142 £ | 267.000 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 5 | (362) | (0,00) |
| 3.156.056 US\$ | 2.596.912 £ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (154.778) | (0,01) |
| 102.364.666 US\$ | 83.356.982 £ | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | (3.908.132) | (0,17) |
| 9.284.919 US\$ | 7.530.334 £ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 54 | (315.593) | (0,01) |
| <i>Abgesicherte Klassen HKD</i> | | | | | | |
| 884.700 HKD | 113.411 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | (73) | (0,00) |
| 25.455 US\$ | 198.925 HKD | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (30) | (0,00) |
| 64.127 US\$ | 500.950 HKD | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | (49) | (0,00) |
| 2.321.386 US\$ | 18.124.281 HKD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | (496) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i> | | | | | | |
| 4.588.184 SEK | 460.110 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (4.545) | (0,00) |
| 216.240.920 SEK | 21.617.162 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 4 | (146.429) | (0,01) |
| 1.079.594 US\$ | 11.726.655 SEK | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 4 | (84.756) | (0,00) |
| 1.223.974 US\$ | 13.167.536 SEK | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 42 | (83.442) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i> | | | | | | |
| 138.841 SGD | 105.338 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (7) | (0,00) |
| 2.098.484 US\$ | 2.852.085 SGD | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | (65.241) | (0,00) |
| 941.854 US\$ | 1.261.419 SGD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 8 | (15.118) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i> | | | | | | |
| 13.324.678 US\$ | 256.447.325 ZAR | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 5 | (679.717) | (0,03) |
| 5.137.181 US\$ | 96.605.146 ZAR | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 74 | (138.353) | (0,01) |
| 16.723.513 ZAR | 914.335 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (1.077) | (0,00) |

High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (0,69 %) (31. Dezember 2022: (1,09 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|----------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR (Fortsetzung)</i> | | | | | | |
| 2.413.198 ZAR | 131.851 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (68) | (0,00) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | (15.391.406) | (0,69) |

Total Return Swap-Kontrakte (0,00 %) (31. Dezember 2022: (0,02 %))

| Nominalwert | Datum der Schließung | Variabler Zinssatz | Referenzunternehmen | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|----------------------|--------------------|--|---------------------------------|----------------------|
| USD 25.000.000 | 20.03.2024 | 5,38 ¹ | iBoxx USD Liquid High Yield Index ² | (51.928) | (0,00) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Total Return Swap-Kontrakten [∞] | | | | (51.928) | (0,00) |

¹ Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist die USD Secured Overnight Financing Rate.

² Die Gegenpartei für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist die JPMorgan Chase Bank.

| | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|---|----------------------|----------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (15.443.334) | (0,69) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | 2.118.262.333 | 94,07 |
| Sonstiges Nettovermögen | 133.548.386 | 5,93 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | 2.251.810.719 | 100,00 |

| Portfolioanalyse | US\$ | % des Gesamtvermögens |
|---|----------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 210.494.768 | 9,23 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 1.828.965.933 | 80,19 |
| † Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente | 49.924.458 | 2,19 |
| µ Investmentfonds | 3.611.285 | 0,16 |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap | 25.265.889 | 1,11 |
| Anlagen insgesamt | 2.118.262.333 | 92,88 |

InnovAsia 5G - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|--|--|------------------|------------------------------|
| Aktien 94,76 % (31. Dezember 2022: 94,06 %) | | | |
| Australischer Dollar | | | |
| 5.440 | Altium Ltd* | 173.907 | 0,73 |
| Australischer Dollar insgesamt | | 173.907 | 0,73 |
| Chinesischer Yuan Renminbi | | | |
| 84.273 | Shenzhen Sinexcel Electric Co Ltd Class A* | 353.988 | 1,49 |
| 41.050 | Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co Ltd Class A* | 254.177 | 1,07 |
| 96.800 | Zhejiang Sanhua Intelligent Controls Co Ltd Class A* | 399.674 | 1,68 |
| Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt | | 1.007.839 | 4,24 |
| Indische Rupie | | | |
| 62.542 | Bharti Airtel Ltd* | 774.130 | 3,26 |
| 8.341 | Polycab India Ltd* | 551.082 | 2,32 |
| 31.696 | Syrma SGS Technology Ltd* | 254.250 | 1,07 |
| 34.360 | Tech Mahindra Ltd* | 525.555 | 2,21 |
| 420.391 | Zomato Ltd* | 624.925 | 2,63 |
| Indische Rupie insgesamt | | 2.729.942 | 11,49 |
| Japanischer Yen | | | |
| 1.700 | Disco Corp* | 421.804 | 1,78 |
| 9.200 | Enplas Corp* | 783.090 | 3,29 |
| 30.700 | Harmonic Drive Systems Inc* | 905.887 | 3,81 |
| 15.700 | JMDC Inc* | 474.742 | 2,00 |
| 11.100 | M3 Inc* | 183.688 | 0,77 |
| 38.300 | Mercari Inc* | 709.737 | 2,99 |
| 12.400 | Nitto Boseki Co Ltd* | 404.157 | 1,70 |
| 34.400 | Rohm Co Ltd* | 659.427 | 2,77 |
| 45.500 | Sansan Inc* | 516.063 | 2,17 |
| 11.100 | Shibaura Mechatronics Corp* | 467.683 | 1,97 |
| 1.300 | SMC Corp* | 698.595 | 2,94 |
| Japanischer Yen insgesamt | | 6.224.873 | 26,19 |
| Malaysischer Ringgit | | | |
| 734.400 | Inari Amertron Bhd* | 481.076 | 2,02 |
| Malaysischer Ringgit insgesamt | | 481.076 | 2,02 |
| Neuer taiwanesischer Dollar | | | |
| 37.000 | Accton Technology Corp* | 630.521 | 2,65 |
| 20.000 | E Ink Holdings Inc* | 128.379 | 0,54 |
| 9.000 | eMemory Technology Inc* | 718.463 | 3,02 |

InnovAsia 5G - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|--|-------------------|----------------------|
| Aktien 94,76 % (31. Dezember 2022: 94,06 %) (Fortsetzung) | | | |
| Neuer taiwanesischer Dollar (Fortsetzung) | | | |
| 29.000 | Faraday Technology Corp* | 337.336 | 1,42 |
| 6.000 | Global Unichip Corp* | 340.171 | 1,43 |
| 34.499 | Jentech Precision Industrial Co Ltd* | 864.428 | 3,64 |
| 42.000 | Novatek Microelectronics Corp* | 707.515 | 2,98 |
| 29.000 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd* | 560.336 | 2,36 |
| 105.000 | Taiwan Union Technology Corp* | 431.078 | 1,81 |
| 14.000 | WinWay Technology Co Ltd* | 382.724 | 1,61 |
| 118.000 | Wistron Corp* | 379.101 | 1,59 |
| Neuer taiwanesischer Dollar insgesamt | | 5.480.052 | 23,05 |
| Singapur-Dollar | | | |
| 214.700 | AEM Holdings Ltd** | 563.158 | 2,37 |
| Singapur-Dollar insgesamt | | 563.158 | 2,37 |
| Südkoreanischer Won | | | |
| 12.816 | HAESUNG DS Co Ltd* | 551.290 | 2,32 |
| 11.235 | Hanmi Semiconductor Co Ltd* | 538.240 | 2,26 |
| 13.042 | HPSP Co Ltd* | 444.050 | 1,87 |
| 6.188 | JYP Entertainment Corp* | 486.718 | 2,05 |
| 2.338 | LEENO Industrial Inc* | 367.610 | 1,55 |
| 9.135 | SK Hynix Inc* | 1.003.652 | 4,22 |
| Südkoreanischer Won insgesamt | | 3.391.560 | 14,27 |
| Thailändischer Baht | | | |
| 70.700 | Delta Electronics Thailand PCL* | 182.278 | 0,77 |
| 179.000 | Hana Microelectronics PCL* | 279.257 | 1,17 |
| 157.400 | KCE Electronics PCL* | 253.629 | 1,07 |
| Thailändischer Baht insgesamt | | 715.164 | 3,01 |
| US-Dollar | | | |
| 4.501 | Fabrinet* | 856.675 | 3,60 |
| 7.268 | Kanzhun Ltd ADR* | 120.722 | 0,51 |
| 3.154 | New Oriental Education & Technology Group Inc ADR* | 231.125 | 0,97 |
| US-Dollar insgesamt | | 1.208.522 | 5,08 |
| Vietnamesischer Dong | | | |
| 138.552 | FPT Corp* | 548.794 | 2,31 |
| Vietnamesischer Dong insgesamt | | 548.794 | 2,31 |
| Aktien insgesamt | | 22.524.887 | 94,76 |
| Anlagen insgesamt | | 22.524.887 | 94,76 |

InnovAsia 5G - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 1,26 % (31. Dezember 2022: 3,07 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|-----------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> | | | | | | |
| 531.695 CHF | 595.388 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 8 | 37.371 | 0,16 |
| 63.284 CHF | 71.251 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 8 | 4.062 | 0,02 |
| 39.998 CHF | 45.265 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 6 | 2.334 | 0,01 |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 232.650 € | 250.588 US\$ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 5 | 6.569 | 0,03 |
| 5.251.244 € | 5.601.452 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 9 | 202.946 | 0,85 |
| 466.356 € | 504.327 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 8 | 11.154 | 0,05 |
| 16.024 US\$ | 14.420 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 85 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i> | | | | | | |
| 58.459 SGD | 43.481 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 5 | 869 | 0,00 |
| 1.595.311 SGD | 1.176.531 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 16 | 33.745 | 0,14 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | 299.135 | 1,26 |
| | | | | | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | | | | | 22.824.022 | 96,02 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,25 %) (31. Dezember 2022: (0,53 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> | | | | | | |
| 13.154 CHF | 15.680 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | (26) | (0,00) |
| 15.053 US\$ | 13.325 CHF | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 3 | (805) | (0,00) |
| 67.715 US\$ | 59.726 CHF | 18.01.2024 | UBS AG | 11 | (3.365) | (0,01) |
| 56.806 US\$ | 50.313 CHF | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 4 | (3.070) | (0,01) |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 120.365 € | 133.297 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | (254) | (0,00) |
| 143.980 US\$ | 135.651 € | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 2 | (5.960) | (0,03) |
| 278.876 US\$ | 259.914 € | 18.01.2024 | UBS AG | 6 | (8.416) | (0,04) |
| 915.592 US\$ | 857.558 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 11 | (32.300) | (0,14) |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i> | | | | | | |
| 12.858 SGD | 9.756 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (2) | (0,00) |
| 21.828 SGD | 16.561 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (1) | (0,00) |
| 37.001 US\$ | 50.280 SGD | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 3 | (1.145) | (0,00) |
| 76.740 US\$ | 103.784 SGD | 18.01.2024 | UBS AG | 5 | (1.995) | (0,01) |
| 114.236 US\$ | 154.263 SGD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 10 | (2.797) | (0,01) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | (60.136) | (0,25) |

InnovAsia 5G - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|-------------------|------------------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (60.136) | (0,25) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | 22.763.886 | 95,77 |
| Sonstiges Nettovermögen | 1.006.234 | 4,23 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | 23.770.120 | 100,00 |

| Portfolioanalyse | US\$ | % des Gesamtver- mögens |
|---|-------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 21.961.729 | 91,60 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 563.158 | 2,35 |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente | 238.999 | 1,00 |
| Anlagen insgesamt | 22.763.886 | 94,95 |

Japan Equity Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert JPY | % des Netto- vermögens |
|--|--|-----------------|------------------------------|
| Aktien 98,67 % (31. Dezember 2022: 98,37 %) | | | |
| Japanischer Yen | | | |
| 65.000 | ABC-Mart Inc | 160.225.000 | 0,99 |
| 420.000 | Amada Co Ltd | 617.400.000 | 3,82 |
| 26.000 | Appier Group Inc | 48.100.000 | 0,30 |
| 50.000 | As One Corp | 280.000.000 | 1,73 |
| 48.000 | Asahi Intecc Co Ltd | 137.688.000 | 0,85 |
| 59.000 | Asics Corp | 260.662.000 | 1,61 |
| 10.000 | BML Inc | 30.000.000 | 0,19 |
| 3.500 | Cover Corp | 9.583.000 | 0,06 |
| 178.000 | Daiei Kankyo Co Ltd | 443.754.000 | 2,74 |
| 360.000 | Daiwa Industries Ltd | 543.600.000 | 3,36 |
| 85.000 | eGuarantee Inc | 174.080.000 | 1,08 |
| 46.000 | eWeLL Co Ltd | 92.506.000 | 0,57 |
| 214.000 | FP Partner Inc | 1.110.660.000 | 6,87 |
| 28.000 | Fujimi Inc | 87.780.000 | 0,54 |
| 11.000 | Genda Inc | 31.427.000 | 0,19 |
| 4.000 | GMO Financial Gate Inc | 41.840.000 | 0,26 |
| 65.000 | Hokkoku Financial Holdings Inc | 300.300.000 | 1,86 |
| 25.000 | Human Technologies Inc | 33.625.000 | 0,21 |
| 24.000 | Inforich Inc | 118.560.000 | 0,73 |
| 37.000 | Japan Elevator Service Holdings Co Ltd | 86.506.000 | 0,53 |
| 260.000 | JSB Co Ltd | 652.080.000 | 4,03 |
| 56.000 | Justsystems Corp | 183.400.000 | 1,13 |
| 120.000 | Kansai Paint Co Ltd | 289.080.000 | 1,79 |
| 29.000 | Keisei Electric Railway Co Ltd | 193.256.000 | 1,19 |
| 451.000 | Kosaido Holdings Co Ltd | 342.760.000 | 2,12 |
| 15.000 | Lawson Inc | 109.245.000 | 0,68 |
| 31.000 | M&A Research Institute Holdings Inc | 138.725.000 | 0,86 |
| 12.000 | Macnica Holdings Inc | 89.244.000 | 0,55 |
| 53.000 | MEC Co Ltd | 232.935.000 | 1,44 |
| 153.000 | Menicon Co Ltd | 359.397.000 | 2,22 |
| 100.000 | MISUMI Group Inc | 238.950.000 | 1,48 |
| 22.000 | Mitsubishi Logistics Corp | 93.478.000 | 0,58 |
| 39.000 | Mitsubishi Pencil Co Ltd | 81.354.000 | 0,50 |
| 130.000 | Musashi Seimitsu Industry Co Ltd | 196.300.000 | 1,21 |
| 94.000 | Nifco Inc | 342.630.000 | 2,12 |
| 60.000 | Niterra Co Ltd | 200.940.000 | 1,24 |
| 240.000 | Okinawa Cellular Telephone Co | 812.400.000 | 5,02 |
| 214.000 | Open Up Group Inc | 502.686.000 | 3,11 |
| 43.000 | Osaka Soda Co Ltd | 416.240.000 | 2,57 |

Japan Equity Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert JPY | % des Nettovermögens |
|--|-----------------------------|-----------------------|----------------------|
| Aktien 98,67 % (31. Dezember 2022: 98,37 %) (Fortsetzung) | | | |
| Japanischer Yen (Fortsetzung) | | | |
| 56.000 | Pasona Group Inc | 147.952.000 | 0,91 |
| 67.000 | Pilot Corp | 281.467.000 | 1,74 |
| 120.000 | Resorttrust Inc | 293.520.000 | 1,81 |
| 455.000 | Ricoh Co Ltd | 492.765.000 | 3,05 |
| 60.000 | Sakai Moving Service Co Ltd | 163.200.000 | 1,01 |
| 29.000 | San-A Co Ltd | 132.095.000 | 0,82 |
| 15.000 | SHO-BOND Holdings Co Ltd | 94.005.000 | 0,58 |
| 120.000 | Shoei Co Ltd | 220.800.000 | 1,36 |
| 10.000 | St Cousair Co Ltd | 25.880.000 | 0,16 |
| 63.000 | TBS Holdings Inc | 188.937.000 | 1,17 |
| 90.000 | TKC Corp | 338.400.000 | 2,09 |
| 64.000 | TKP Corp | 115.072.000 | 0,71 |
| 96.000 | Tokyo Century Corp | 146.592.000 | 0,91 |
| 35.000 | Tokyo Seimitsu Co Ltd | 303.485.000 | 1,88 |
| 25.000 | Tokyotokeiba Co Ltd | 110.875.000 | 0,69 |
| 600.000 | Tokyu Fudosan Holdings Corp | 540.840.000 | 3,34 |
| 235.000 | Transaction Co Ltd | 501.725.000 | 3,10 |
| 222.000 | TRYT Inc | 126.318.000 | 0,78 |
| 184.000 | USS Co Ltd | 521.824.000 | 3,23 |
| 55.000 | WingArc1st Inc | 169.125.000 | 1,05 |
| 20.000 | Yamaha Corp | 65.140.000 | 0,40 |
| 320.000 | Yamanashi Chuo Bank Ltd | 537.920.000 | 3,32 |
| 80.000 | Yokogawa Electric Corp | 215.120.000 | 1,33 |
| 36.000 | Zuken Inc | 145.440.000 | 0,90 |
| | Aktien insgesamt * | 15.961.893.000 | 98,67 |
| | Anlagen insgesamt | 15.961.893.000 | 98,67 |

Devisenterminkontrakte 0,79 % (31. Dezember 2022: 0,22 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn JPY | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|-------------------------------|----------------------|
| 215 £ | 38.497 ¥ | 09.01.2024 | Brown Brothers Harriman | 5 | 45 | 0,00 |
| 671 £ | 120.491 ¥ | 05.01.2024 | Brown Brothers Harriman | 5 | 1 | 0,00 |
| 7.946.271 ¥ | 43.833 £ | 04.01.2024 | Brown Brothers Harriman | 3 | 69.676 | 0,00 |
| 28.392 ¥ | 158 £ | 05.01.2024 | Brown Brothers Harriman | 2 | 0 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 740 € | 114.131 ¥ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 901 | 0,00 |
| 468.489.324 ¥ | 2.995.444 € | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 6 | 2.852.150 | 0,02 |
| 291.393.419 ¥ | 1.853.022 € | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 9 | 3.343.987 | 0,02 |
| 9.865.576.727 ¥ | 62.679.763 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 7 | 122.103.474 | 0,75 |

Japan Equity Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 0,79 % (31. Dezember 2022: 0,22 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn JPY | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|-------------------------------|-------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 14.036 £ | 2.513.266 ¥ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 2 | 3.499 | 0,00 |
| 2.260.915 ¥ | 12.564 £ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 3 | 8.091 | 0,00 |
| 9.561.820 ¥ | 52.756 £ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 13 | 102.255 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | 128.484.079 | 0,79 |
| | | | | | Zeitwert JPY | % des Nettovermögens |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | | | | | 16.090.377.079 | 99,46 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,26 %) (31. Dezember 2022: (0,69 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust JPY | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|-------------------------|
| 14.052 £ | 2.547.444 ¥ | 04.01.2024 | Brown Brothers Harriman | 8 | (22.337) | (0,00) |
| 1.095.536 ¥ | 6.108 £ | 09.01.2024 | Brown Brothers Harriman | 4 | (1.271) | (0,00) |
| 473.739 ¥ | 2.637 £ | 05.01.2024 | Brown Brothers Harriman | 2 | (11) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 1.360.046 € | 212.269.012 ¥ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 2 | (851.944) | (0,00) |
| 66.143.954 € | 10.320.450.468 ¥ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 15 | (38.474.067) | (0,24) |
| 936.620 € | 147.019.903 ¥ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 5 | (1.423.816) | (0,01) |
| 84.913 ¥ | 550 € | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | (584) | (0,00) |
| 136.027.230 ¥ | 880.642 € | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | (867.221) | (0,01) |
| 33.482 ¥ | 216 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (95) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 318.781 £ | 57.339.575 ¥ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 2 | (179.661) | (0,00) |
| 70.994 £ | 12.903.034 ¥ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 18 | (173.251) | (0,00) |
| 8.070 £ | 1.449.667 ¥ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (2.652) | (0,00) |
| 640.347 ¥ | 3.601 £ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | (5.342) | (0,00) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | (42.002.252) | (0,26) |
| | | | | | Zeitwert JPY | % des Nettovermögens |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | | | | | (42.002.252) | (0,26) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | | | | | 16.048.374.827 | 99,20 |
| Sonstiges Nettovermögen | | | | | 129.153.888 | 0,80 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | | | | | 16.177.528.715 | 100,00 |

Japan Equity Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

| Portfolioanalyse | JPY | % des Gesamtver- mögens |
|---|-----------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 15.961.893.000 | 98,32 |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente | 86.481.827 | 0,53 |
| Anlagen insgesamt | 16.048.374.827 | 98,85 |

Macro Opportunities FX - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert EUR | % des Netto- vermögens |
|---|-------------------------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Schatzwechsel 83,54 % (31. Dezember 2022: 13,93 %) | | | | | |
| Euro | | | | | |
| 300.000 | Finland T-Bill | 0,00 % | 13.03.2024 | 297.782 | 10,33 |
| 650.000 | Finland T-Bill | 0,00 % | 14.05.2024 | 641.126 | 22,25 |
| 550.000 | France Treasury Bill BTF | 0,00 % | 12.06.2024 | 541.369 | 18,79 |
| 450.000 | German Treasury Bill | 0,00 % | 17.04.2024 | 445.211 | 15,45 |
| 490.000 | German Treasury Bill | 0,00 % | 19.06.2024 | 481.888 | 16,72 |
| Schatzwechsel insgesamt ** | | | | 2.407.376 | 83,54 |
| Staatsanleihen 12,04 % (31. Dezember 2022: 8,82 %) | | | | | |
| Euro | | | | | |
| 350.000 | French Republic Government Bond OAT | 0,00 % | 25.03.2024 | 347.166 | 12,04 |
| Staatsanleihen insgesamt * | | | | 347.166 | 12,04 |
| Anlagen insgesamt | | | | 2.754.542 | 95,58 |

Devisenterminkontrakte 160,57 % (31. Dezember 2022: 11,48 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeits- datum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn EUR | % des Nettover- mögens |
|-----------------------|------------------------|-----------------------|--------------------------------|-----------|-------------------------------------|------------------------------|
| 2.852.874 AUD | 1.822.756 US\$ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 2 | 113.012 | 3,92 |
| 7.629.279 AUD | 4.873.486 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 6 | 303.131 | 10,52 |
| 4.568.708 AUD | 2.945.374 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 5 | 157.152 | 5,45 |
| 4.552.010 AUD | 2.960.172 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | 133.451 | 4,63 |
| 4.237.668 AUD | 2.694.110 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | 180.006 | 6,25 |
| 5.695.363 BRL | 1.114.726 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | 51.082 | 1,77 |
| 1.324.755 CAD | 960.637 US\$ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 2 | 40.041 | 1,39 |
| 2.133.539 CAD | 1.557.897 US\$ | 18.01.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | 54.739 | 1,90 |
| 1.976.320 CAD | 1.434.618 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | 58.376 | 2,03 |
| 1.620.193 CAD | 1.188.842 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 3 | 36.333 | 1,26 |
| 1.883.723 CAD | 1.368.392 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 4 | 54.744 | 1,90 |
| 444.468 CAD | 327.865 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 8.403 | 0,29 |
| 2.315.360 CHF | 2.591.097 US\$ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 3 | 148.705 | 5,16 |
| 3.107.431 CHF | 3.528.311 US\$ | 18.01.2024 | Deutsche Bank AG | 2 | 153.605 | 5,33 |
| 1.801.878 CHF | 2.020.814 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 5 | 111.791 | 3,88 |
| 603.253 CHF | 678.880 US\$ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 35.319 | 1,23 |
| 724.827 CHF | 813.957 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 2 | 44.010 | 1,53 |
| 1.029.375 CHF | 1.173.897 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | 46.269 | 1,61 |
| 135.521 CHF | 152.062 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 8.340 | 0,29 |

Macro Opportunities FX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 160,57 % (31. Dezember 2022: 11,48 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn EUR | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|-------------------------------|----------------------|
| 279.027.059 CLP | 300.627 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 16.865 | 0,58 |
| 616.851.210 CLP | 660.440 US\$ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 41.049 | 1,42 |
| 15.252.551 CZK | 656.435 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | 23.226 | 0,81 |
| 2.239.677 CZK | 99.179 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 888 | 0,03 |
| 7.354.180 € | 7.829.077 US\$ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 9 | 271.210 | 9,41 |
| 2.782.268 € | 2.966.488 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | 98.484 | 3,42 |
| 577.655 € | 620.902 US\$ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 2 | 15.925 | 0,55 |
| 569.109 € | 611.960 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 15.468 | 0,54 |
| 1.762.637 € | 1.919.636 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | 25.942 | 0,90 |
| 314.892 € | 333.832 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 12.874 | 0,45 |
| 1.883.944 £ | 2.309.425 US\$ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 5 | 83.628 | 2,90 |
| 1.288.214 £ | 1.601.926 US\$ | 18.01.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | 36.580 | 1,27 |
| 1.534.592 £ | 1.871.386 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | 76.975 | 2,67 |
| 251.738 £ | 310.566 US\$ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 9.388 | 0,33 |
| 487.112 £ | 596.889 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 21.836 | 0,76 |
| 529.712 £ | 659.769 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | 14.083 | 0,49 |
| 65.368.101 HUF | 176.013 US\$ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 1 | 11.298 | 0,39 |
| 165.271.276 HUF | 457.231 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | 17.515 | 0,61 |
| 40.456.962 HUF | 114.783 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 1.702 | 0,06 |
| 18.076.133 IDR | 1.146 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | 24 | 0,00 |
| 33.875.351 ¥ | 230.567 US\$ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 1 | 9.316 | 0,32 |
| 12.578.384 ¥ | 86.002 US\$ | 18.01.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | 3.107 | 0,11 |
| 400.092.780 ¥ | 2.695.316 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 135.225 | 4,69 |
| 229.381.639 ¥ | 1.564.325 US\$ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 60.299 | 2,09 |
| 32.141.567 ¥ | 227.635 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 815 | 0,03 |
| 137.980.589 ¥ | 925.646 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 50.156 | 1,74 |
| 702.377 KRW | 527 US\$ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 13 | 0,00 |
| 38.914.647 MXN | 2.114.058 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 4 | 160.961 | 5,58 |
| 10.676.500 MXN | 603.022 US\$ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 23.339 | 0,81 |
| 6.084.280 NOK | 553.361 US\$ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 3 | 41.598 | 1,44 |
| 1.378.859 NOK | 127.866 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 7.202 | 0,25 |
| 5.027.941 NOK | 455.560 US\$ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 35.940 | 1,25 |
| 6.383.998 NOK | 582.690 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 3 | 41.775 | 1,45 |
| 24.959.176 NOK | 2.284.160 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 4 | 157.855 | 5,48 |
| 575.947 NZD | 346.887 US\$ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 1 | 16.100 | 0,56 |
| 3.705.800 NZD | 2.174.309 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 4 | 155.754 | 5,40 |
| 3.658.698 NZD | 2.139.652 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 4 | 160.126 | 5,56 |
| 1.125.307 NZD | 668.620 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | 39.727 | 1,38 |
| 1.269.426 PLN | 299.336 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 21.189 | 0,73 |
| 3.274.344 PLN | 802.351 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 4 | 27.290 | 0,95 |

Macro Opportunities FX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 160,57 % (31. Dezember 2022: 11,48 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn EUR | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|-------------------------------|----------------------|
| 3.020.920 PLN | 717.052 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 3 | 46.167 | 1,60 |
| 25.879.864 SEK | 2.370.321 US\$ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 5 | 180.317 | 6,26 |
| 87.849.997 SEK | 8.371.942 US\$ | 18.01.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | 317.326 | 11,01 |
| 14.214.889 SEK | 1.306.167 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 5 | 95.211 | 3,30 |
| 4.095.471 SEK | 398.009 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 2 | 7.811 | 0,27 |
| 172.819 ZAR | 8.954 US\$ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 1 | 438 | 0,01 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 175.554 £ | 202.323 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | 163 | 0,01 |
| 1.107 £ | 1.267 € | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 2 | 10 | 0,00 |
| 148 £ | 169 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 1 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i> | | | | | | |
| 20.862 € | 230.550 SEK | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 152 | 0,01 |
| 45.102 € | 500.734 SEK | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 6 | 122 | 0,00 |
| 109.459 SEK | 9.713 € | 18.01.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | 120 | 0,00 |
| 1.058.070 SEK | 91.074 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | 3.970 | 0,14 |
| 42.869.356 SEK | 3.702.912 € | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 4 | 147.975 | 5,14 |
| 42.318.537 SEK | 3.655.230 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 37 | 146.180 | 5,07 |
| <i>Abgesicherte Klassen USD</i> | | | | | | |
| 562 € | 604 US\$ | 18.01.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | 16 | 0,00 |
| 1.573 € | 1.720 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | 17 | 0,00 |
| 950 € | 1.022 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 2 | 26 | 0,00 |
| 501 € | 535 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 17 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | 4.627.295 | 160,57 |

| | Zeitwert EUR | % des Nettovermögens |
|--|------------------|----------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 7.381.837 | 256,15 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (160,09 %) (31. Dezember 2022: (14,06 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust EUR | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|-------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 1.188.658 US\$ | 13.082.727 SEK | 18.01.2024 | BNP Paribas | 4 | (99.822) | (3,46) |
| 175.838 US\$ | 864.596 BRL | 18.01.2024 | BNP Paribas | 1 | (1.770) | (0,06) |
| 1.670.174 US\$ | 18.473.374 NOK | 18.01.2024 | BNP Paribas | 4 | (135.321) | (4,70) |
| 886.259 US\$ | 3.733.412 PLN | 18.01.2024 | BNP Paribas | 2 | (56.975) | (1,98) |
| 1.970.424 US\$ | 289.974.776 ¥ | 18.01.2024 | BNP Paribas | 3 | (82.679) | (2,87) |
| 631.917 US\$ | 11.663.946 MXN | 18.01.2024 | BNP Paribas | 1 | (49.813) | (1,73) |
| 2.851.371 US\$ | 4.411.285 AUD | 18.01.2024 | BNP Paribas | 6 | (144.966) | (5,03) |

Macro Opportunities FX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (160,09 %) (31. Dezember 2022: (14,06 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust EUR | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 178.331 US\$ | 65.399.430 HUF | 18.01.2024 | BNP Paribas | 1 | (9.282) | (0,32) |
| 5.115.992 US\$ | 4.175.425 € | 18.01.2024 | BNP Paribas | 4 | (187.549) | (6,51) |
| 2.994.461 US\$ | 2.664.992 CHF | 18.01.2024 | BNP Paribas | 5 | (160.219) | (5,56) |
| 314.240 US\$ | 293.299.212 CLP | 18.01.2024 | BNP Paribas | 1 | (19.323) | (0,67) |
| 2.982.970 US\$ | 4.084.532 CAD | 18.01.2024 | BNP Paribas | 5 | (104.369) | (3,62) |
| 1.228.413 US\$ | 2.085.732 NZD | 18.01.2024 | BNP Paribas | 2 | (83.457) | (2,90) |
| 2.531.671 US\$ | 2.371.797 € | 18.01.2024 | BNP Paribas | 4 | (81.392) | (2,82) |
| 109.860 US\$ | 86.419 € | 18.01.2024 | Citibank NA | 1 | (286) | (0,01) |
| 685.646 US\$ | 102.541.909 ¥ | 18.01.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | (39.317) | (1,36) |
| 1.030.145 US\$ | 1.727.817 NZD | 18.01.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | (57.800) | (2,01) |
| 1.136.518 US\$ | 1.067.961 € | 18.01.2024 | Deutsche Bank AG | 2 | (39.752) | (1,38) |
| 754.437 US\$ | 680.895 CHF | 18.01.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | (50.557) | (1,75) |
| 2.584.454 US\$ | 3.553.769 CAD | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 4 | (100.664) | (3,49) |
| 2.967.207 US\$ | 2.788.215 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (103.781) | (3,60) |
| 705.721 US\$ | 12.910.077 MXN | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (49.441) | (1,72) |
| 3.484.980 US\$ | 37.924.228 SEK | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 6 | (253.810) | (8,81) |
| 846.969 US\$ | 4.229.309 BRL | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 4 | (20.574) | (0,71) |
| 274.675 US\$ | 245.463 CHF | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (15.784) | (0,55) |
| 912.249 US\$ | 3.831.196 PLN | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (55.955) | (1,94) |
| 1.515.080 US\$ | 2.549.219 NZD | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | (89.616) | (3,11) |
| 2.051.402 US\$ | 3.203.024 AUD | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 4 | (122.424) | (4,25) |
| 295.752 US\$ | 43.834.033 ¥ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (14.404) | (0,50) |
| 638.568 US\$ | 517.199 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (18.831) | (0,65) |
| 7.664.505 US\$ | 81.121.342 SEK | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 2 | (352.921) | (12,25) |
| 621.711 US\$ | 578.191.193 CLP | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | (36.067) | (1,25) |
| 1.505.238 US\$ | 2.066.679 CAD | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 2 | (56.496) | (1,96) |
| 3.461.914 US\$ | 3.237.047 € | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 4 | (105.052) | (3,65) |
| 74 US\$ | 534 CNY | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | (1) | (0,00) |
| 1.509.291 US\$ | 1.237.899 € | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | (62.353) | (2,16) |
| 6.873.090 US\$ | 10.552.845 AUD | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 5 | (299.811) | (10,40) |
| 724.948 US\$ | 7.999.840 NOK | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 2 | (57.076) | (1,98) |
| 1.131.122 US\$ | 19.803.634 MXN | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 4 | (31.901) | (1,11) |
| 153.107 US\$ | 54.632.541 HUF | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | (4.014) | (0,14) |
| 253.972 US\$ | 238.057 € | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 2 | (8.288) | (0,29) |
| 1.057.165 US\$ | 153.949.540 ¥ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 3 | (33.894) | (1,18) |
| 219.166 US\$ | 355.449 NZD | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 2 | (5.338) | (0,19) |
| 2.087.488 US\$ | 1.870.099 CHF | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 2 | (124.923) | (4,33) |
| 1.478.723 US\$ | 16.353.929 SEK | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 3 | (131.246) | (4,55) |
| 2.081.375 US\$ | 1.951.535 € | 18.01.2024 | UBS AG | 3 | (68.513) | (2,38) |
| 303.036 US\$ | 110.559.501 HUF | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (14.279) | (0,50) |

Macro Opportunities FX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (160,09 %) (31. Dezember 2022: (14,06 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust EUR | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|---------------------------------|
| 6.118.548 US\$ | 5.415.102 CHF | 18.01.2024 | UBS AG | 4 | (294.810) | (10,23) |
| 98.474 US\$ | 1.031.750 SEK | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (3.591) | (0,12) |
| 1.341.901 US\$ | 197.466.755 ¥ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (56.227) | (1,95) |
| 632.555 US\$ | 14.697.998 CZK | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | (22.394) | (0,78) |
| 630.566 US\$ | 1.044.028 NZD | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (27.594) | (0,96) |
| 1.403.211 US\$ | 15.425.057 NOK | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | (105.180) | (3,65) |
| 2.554.844 US\$ | 4.008.639 AUD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | (164.542) | (5,71) |
| 947.509 US\$ | 890.515 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (33.304) | (1,16) |
| 623.334 US\$ | 512.453 £ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (27.139) | (0,94) |
| 1.035.603 US\$ | 1.713.257 NZD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | (44.521) | (1,54) |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 2.754 € | 2.408 £ | 18.01.2024 | Deutsche Bank AG | 4 | (23) | (0,00) |
| 1.283 € | 1.124 £ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (13) | (0,00) |
| 2.416 € | 2.101 £ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 3 | (8) | (0,00) |
| 171.899 € | 150.817 £ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (2.056) | (0,07) |
| 134 £ | 156 € | 18.01.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | (1) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i> | | | | | | |
| 201.593 € | 2.323.758 SEK | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 5 | (7.148) | (0,25) |
| 38.796 € | 443.227 SEK | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | (1.019) | (0,04) |
| 5.782.267 € | 66.359.416 SEK | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 62 | (178.691) | (6,20) |
| 516 SEK | 48 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | 0 | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen USD</i> | | | | | | |
| 1.145 € | 1.269 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (3) | (0,00) |
| 621 US\$ | 563 € | 18.01.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | (1) | (0,00) |
| 1.947 US\$ | 1.834 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (72) | (0,00) |
| 1.023 US\$ | 951 € | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 2 | (25) | (0,00) |
| 95.600 US\$ | 89.717 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 4 | (3.227) | (0,10) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | (4.613.695) | (160,09) |
| | | | | | Zeitwert EUR | % des Nettovermögens |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | | | | | (4.613.695) | (160,09) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | | | | | 2.768.142 | 96,06 |
| Sonstiges Nettovermögen | | | | | 113.664 | 3,94 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | | | | | 2.881.806 | 100,00 |

Macro Opportunities FX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

| Portfolioanalyse | EUR | % des Gesamtver- mögens |
|---|------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 347.166 | 4,60 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 2.407.376 | 31,89 |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente | 13.600 | 0,18 |
| Anlagen insgesamt | 2.768.142 | 36,67 |

Next Generation Mobility - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|--|---------------------------------------|------------------|------------------------------|
| Aktien 91,99 % (31. Dezember 2022: 92,48 %) | | | |
| Kanadischer Dollar | | | |
| 21.648 | First Quantum Minerals Ltd | 178.129 | 0,11 |
| 12.556 | Magna International Inc | 745.495 | 0,45 |
| Kanadischer Dollar insgesamt | | 923.624 | 0,56 |
| Chinesischer Yuan Renminbi | | | |
| 32.300 | StarPower Semiconductor Ltd Class A | 821.040 | 0,50 |
| Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt | | 821.040 | 0,50 |
| Euro | | | |
| 19.540 | BE Semiconductor Industries NV | 2.945.254 | 1,79 |
| 17.763 | Infineon Technologies AG | 741.708 | 0,45 |
| 23.781 | Schneider Electric SE | 4.775.303 | 2,91 |
| Euro insgesamt | | 8.462.265 | 5,15 |
| Hongkong-Dollar | | | |
| 48.200 | Baidu Inc Class A | 716.653 | 0,43 |
| 37.000 | BYD Co Ltd - H Shares | 1.015.912 | 0,62 |
| 69.572 | JD.com Inc Class A | 1.002.344 | 0,61 |
| 103.236 | Sunny Optical Technology Group Co Ltd | 936.700 | 0,57 |
| Hongkong-Dollar insgesamt | | 3.671.609 | 2,23 |
| Japanischer Yen | | | |
| 106.842 | Murata Manufacturing Co Ltd | 2.268.251 | 1,38 |
| 37.541 | Taiyo Yuden Co Ltd | 993.247 | 0,60 |
| Japanischer Yen insgesamt | | 3.261.498 | 1,98 |
| Neuer taiwanesischer Dollar | | | |
| 50.000 | MediaTek Inc | 1.653.606 | 1,01 |
| Neuer taiwanesischer Dollar insgesamt | | 1.653.606 | 1,01 |
| Südkoreanischer Won | | | |
| 1.839 | LG Chem Ltd | 707.323 | 0,43 |
| 2.068 | LG Energy Solution Ltd | 682.472 | 0,42 |
| Südkoreanischer Won insgesamt | | 1.389.795 | 0,85 |
| Schwedische Krone | | | |
| 101.682 | Epiroc AB Class A | 2.040.128 | 1,24 |
| Schwedische Krone insgesamt | | 2.040.128 | 1,24 |

Next Generation Mobility - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---|---------------|----------------------|
| Aktien 91,99 % (31. Dezember 2022: 92,48 %) (Fortsetzung) | | | |
| US-Dollar | | | |
| 17.596 | Advanced Micro Devices Inc | 2.593.826 | 1,58 |
| 7.640 | Air Products & Chemicals Inc | 2.091.832 | 1,27 |
| 4.135 | Albemarle Corp | 597.425 | 0,36 |
| 9.658 | Alphabet Inc Class A | 1.349.126 | 0,82 |
| 28.438 | Altair Engineering Inc Class A | 2.393.058 | 1,46 |
| 13.470 | Amazon.com Inc | 2.046.632 | 1,25 |
| 24.402 | Ambarella Inc | 1.495.599 | 0,91 |
| 64.190 | Amphenol Corp Class A | 6.363.155 | 3,87 |
| 22.859 | Analog Devices Inc | 4.538.883 | 2,76 |
| 12.473 | ANSYS Inc | 4.526.202 | 2,75 |
| 23.762 | Applied Materials Inc | 3.851.107 | 2,34 |
| 32.399 | Aptiv Plc | 2.906.838 | 1,77 |
| 5.958 | ASML Holding NV | 4.509.729 | 2,74 |
| 11.311 | Autodesk Inc | 2.754.002 | 1,68 |
| 118.338 | Ballard Power Systems Inc | 437.851 | 0,27 |
| 19.352 | Cadence Design Systems Inc | 5.270.904 | 3,21 |
| 16.714 | Caterpillar Inc | 4.941.828 | 3,01 |
| 8.962 | Deere & Co | 3.583.635 | 2,18 |
| 67.199 | General Motors Co | 2.413.788 | 1,47 |
| 92.071 | Gentex Corp | 3.007.039 | 1,83 |
| 13.861 | Globalfoundries Inc | 839.977 | 0,51 |
| 15.881 | Keysight Technologies Inc | 2.526.508 | 1,54 |
| 3.760 | Lam Research Corp | 2.945.058 | 1,79 |
| 38.121 | Lattice Semiconductor Corp | 2.629.968 | 1,60 |
| 12.703 | Linde Plc | 5.217.249 | 3,17 |
| 15.884 | Micron Technology Inc | 1.355.541 | 0,82 |
| 17.735 | Mobileye Global Inc Class A | 768.280 | 0,47 |
| 6.518 | Monolithic Power Systems Inc | 4.111.424 | 2,50 |
| 179.324 | MP Materials Corp | 3.559.581 | 2,17 |
| 29.766 | NIO Inc ADR | 269.978 | 0,16 |
| 9.752 | NVIDIA Corp | 4.829.385 | 2,94 |
| 13.894 | NXP Semiconductors NV | 3.191.174 | 1,94 |
| 29.933 | ON Semiconductor Corp | 2.500.304 | 1,52 |
| 9.271 | Qorvo Inc | 1.044.007 | 0,64 |
| 50.332 | Rambus Inc | 3.435.159 | 2,09 |
| 2.509 | S&P Global Inc | 1.105.265 | 0,67 |
| 42.075 | Sensata Technologies Holding Plc | 1.580.758 | 0,96 |
| 14.810 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR | 1.540.240 | 0,94 |

Next Generation Mobility - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|------------------------------|--------------------|----------------------|
| Aktien 91,99 % (31. Dezember 2022: 92,48 %) (Fortsetzung) | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | |
| 32.080 | TE Connectivity Ltd | 4.507.240 | 2,74 |
| 14.159 | Tesla Inc | 3.518.228 | 2,14 |
| 12.855 | Texas Instruments Inc | 2.191.263 | 1,33 |
| 23.384 | T-Mobile US Inc | 3.749.157 | 2,28 |
| 86.499 | Trimble Inc | 4.601.747 | 2,80 |
| 49.813 | Uber Technologies Inc | 3.066.986 | 1,87 |
| 5.576 | Verisk Analytics Inc Class A | 1.331.883 | 0,81 |
| 3.982 | Zscaler Inc | 882.252 | 0,54 |
| US-Dollar insgesamt | | 128.971.071 | 78,47 |
| Aktien insgesamt * | | 151.194.636 | 91,99 |
| Immobilienaktiengesellschaften 0,99 % (31. Dezember 2022: 1,03 %) | | | |
| US-Dollar | | | |
| 12.151 | Prologis Inc | 1.619.728 | 0,99 |
| Immobilienaktiengesellschaften insgesamt * | | 1.619.728 | 0,99 |
| Anlagen insgesamt | | 152.814.364 | 92,98 |

Devisenterminkontrakte 0,01 % (31. Dezember 2022: 0,20 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 22.420 € | 24.272 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 6 | 510 | 0,00 |
| 262.816 € | 280.221 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 10 | 10.281 | 0,01 |
| 258.617 € | 275.862 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 15 | 9.998 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ^{oo} | | | | | 20.789 | 0,01 |

| | | | | | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|--|--|--|--|--------------------|----------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | | | | | 152.835.153 | 92,99 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,01 %) (31. Dezember 2022: (0,14 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 3.842 € | 4.257 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (10) | (0,00) |
| 23.490 US\$ | 21.992 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 4 | (820) | (0,00) |
| 1.430 US\$ | 1.335 € | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (45) | (0,00) |
| 345.164 US\$ | 320.857 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 13 | (9.490) | (0,01) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ^{oo} | | | | | (10.365) | (0,01) |

Next Generation Mobility - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--------------------|------------------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (10.365) | (0,01) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | 152.824.788 | 92,98 |
| Sonstiges Nettovermögen | 11.531.277 | 7,02 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | 164.356.065 | 100,00 |

| Portfolioanalyse | US\$ | % des Gesamtver- mögens |
|---|--------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 152.814.364 | 92,43 |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente | 10.424 | 0,01 |
| Anlagen insgesamt | 152.824.788 | 92,44 |

Next Generation Space Economy - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|--|--|------------------|------------------------------|
| Aktien 94,58 % (31. Dezember 2022: 94,00 %) | | | |
| Chinesischer Yuan Renminbi | | | |
| 67.020 | Shanghai Huace Navigation Technology Ltd Class A | 291.964 | 1,48 |
| Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt | | 291.964 | 1,48 |
| Euro | | | |
| 3.321 | Airbus SE | 512.789 | 2,60 |
| 14.835 | Avio SpA | 138.638 | 0,70 |
| 10.331 | AXA SA | 336.544 | 1,70 |
| 39.419 | Eutelsat Communications SACA | 185.063 | 0,94 |
| 3.528 | Safran SA | 621.448 | 3,15 |
| 2.396 | Thales SA | 354.531 | 1,79 |
| Euro insgesamt | | 2.149.013 | 10,88 |
| Japanischer Yen | | | |
| 16.200 | Mitsubishi Electric Corp | 229.705 | 1,16 |
| 7.200 | Mitsubishi Heavy Industries Ltd | 420.877 | 2,13 |
| 5.700 | NEC Corp | 337.601 | 1,71 |
| 33.700 | SKY Perfect JSAT Holdings Inc | 166.850 | 0,85 |
| 36.300 | Toray Industries Inc | 188.761 | 0,96 |
| Japanischer Yen insgesamt | | 1.343.794 | 6,81 |
| Neuer taiwanesischer Dollar | | | |
| 36.000 | Universal Microwave Technology Inc | 190.613 | 0,96 |
| Neuer taiwanesischer Dollar insgesamt | | 190.613 | 0,96 |
| Britisches Pfund | | | |
| 27.769 | BAE Systems Plc | 393.116 | 1,99 |
| 204.682 | Spirent Communications Plc | 321.725 | 1,63 |
| Britisches Pfund insgesamt | | 714.841 | 3,62 |
| Singapur-Dollar | | | |
| 200.500 | Singapore Technologies Engineering Ltd | 591.271 | 2,99 |
| Singapur-Dollar insgesamt | | 591.271 | 2,99 |
| Südkoreanischer Won | | | |
| 2.904 | Hanwha Aerospace Co Ltd | 280.151 | 1,42 |
| 13.135 | Intellian Technologies Inc | 736.142 | 3,73 |
| Südkoreanischer Won insgesamt | | 1.016.293 | 5,15 |
| US-Dollar | | | |
| 3.713 | Advanced Micro Devices Inc | 547.333 | 2,77 |

Next Generation Space Economy - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---|-------------------|----------------------|
| Aktien 94,58 % (31. Dezember 2022: 94,00 %) (Fortsetzung) | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | |
| 3.043 | Amazon.com Inc | 462.353 | 2,34 |
| 954 | Analog Devices Inc | 189.426 | 0,96 |
| 1.067 | ANSYS Inc | 387.193 | 1,96 |
| 387 | ASML Holding NV | 292.928 | 1,48 |
| 3.554 | Boeing Co | 926.386 | 4,69 |
| 901 | CACI International Inc Class A | 291.798 | 1,48 |
| 683 | CrowdStrike Holdings Inc Class A | 174.384 | 0,88 |
| 1.217 | Deere & Co | 486.642 | 2,46 |
| 3.800 | Hexcel Corp | 280.250 | 1,42 |
| 10.133 | Iridium Communications Inc | 417.074 | 2,11 |
| 734 | Jacobs Solutions Inc | 95.273 | 0,48 |
| 3.398 | Keysight Technologies Inc | 540.588 | 2,74 |
| 13.625 | Kratos Defense & Security Solutions Inc | 276.451 | 1,40 |
| 779 | Lockheed Martin Corp | 353.074 | 1,79 |
| 1.007 | Microsoft Corp | 378.672 | 1,92 |
| 1.340 | Motorola Solutions Inc | 419.541 | 2,13 |
| 4.816 | NV5 Global Inc | 535.154 | 2,71 |
| 1.075 | NVIDIA Corp | 532.361 | 2,70 |
| 2.356 | Okta Inc Class A | 213.289 | 1,08 |
| 1.118 | Palo Alto Networks Inc | 329.676 | 1,67 |
| 134.323 | Planet Labs PBC | 331.778 | 1,68 |
| 3.972 | QUALCOMM Inc | 574.470 | 2,91 |
| 147.626 | Rocket Lab USA Inc | 816.372 | 4,13 |
| 1.993 | Teledyne Technologies Inc | 889.456 | 4,51 |
| 507 | TransDigm Group Inc | 512.881 | 2,60 |
| 8.888 | Trimble Inc | 472.842 | 2,40 |
| 4.593 | Uber Technologies Inc | 282.791 | 1,43 |
| 43.963 | Virgin Galactic Holdings Inc | 107.709 | 0,55 |
| 1.168 | Zscaler Inc | 258.782 | 1,31 |
| | US-Dollar insgesamt | 12.376.927 | 62,69 |
| | Aktien insgesamt * | 18.674.716 | 94,58 |
| | Anlagen insgesamt | 18.674.716 | 94,58 |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | | 18.674.716 | 94,58 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | | 18.674.716 | 94,58 |
| Sonstiges Nettovermögen | | 1.069.214 | 5,42 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | | 19.743.930 | 100,00 |

Next Generation Space Economy - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

| Portfolioanalyse | US\$ | % des Gesamtver- mögens |
|---|-------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 18.674.716 | 94,36 |
| Anlagen insgesamt | 18.674.716 | 94,36 |

Responsible Asian Debt – Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Schatzwechsel 3,90 % (31. Dezember 2022: 0,00 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 2.500.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 11.01.2024 | 2.496.736 | 3,90 |
| Schatzwechsel insgesamt ** | | | | 2.496.736 | 3,90 |
| Unternehmensanleihen 71,46 % (31. Dezember 2022: 83,65 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 200.000 | Adani Green Energy Ltd* | 4,38 % | 08.09.2024 | 193.241 | 0,30 |
| 700.000 | Adani Green Energy UP Ltd/Prayatna Developers Pvt Ltd/Parampujya Solar Energ* | 6,25 % | 10.12.2024 | 692.578 | 1,08 |
| 200.000 | AIA Group Ltd* | 2,70 % | 29.12.2049 | 182.337 | 0,29 |
| 200.000 | AIA Group Ltd* | 3,20 % | 16.09.2040 | 151.942 | 0,24 |
| 400.000 | AIA Group Ltd** | 4,95 % | 04.04.2033 | 403.060 | 0,63 |
| 200.000 | AIA Group Ltd* | 5,63 % | 25.10.2027 | 206.414 | 0,32 |
| 200.000 | Alibaba Group Holding Ltd* | 2,13 % | 09.02.2031 | 165.852 | 0,26 |
| 300.000 | Alibaba Group Holding Ltd* | 2,70 % | 09.02.2041 | 205.478 | 0,32 |
| 200.000 | Alibaba Group Holding Ltd* | 3,40 % | 06.12.2027 | 189.767 | 0,30 |
| 200.000 | Alibaba Group Holding Ltd* | 4,00 % | 06.12.2037 | 172.033 | 0,27 |
| 200.000 | Alibaba Group Holding Ltd* | 4,40 % | 06.12.2057 | 163.105 | 0,26 |
| 200.000 | Axiata SPV2 Bhd** | 2,16 % | 19.08.2030 | 170.346 | 0,27 |
| 400.000 | Axis Bank Ltd* | 4,10 % | 29.12.2049 | 365.433 | 0,57 |
| 200.000 | Baidu Inc** | 2,38 % | 23.08.2031 | 165.757 | 0,26 |
| 400.000 | Bangkok Bank PCL** | 3,73 % | 25.09.2034 | 355.844 | 0,56 |
| 200.000 | Bangkok Bank PCL* | 4,30 % | 15.06.2027 | 196.095 | 0,31 |
| 200.000 | Bangkok Bank PCL** | 5,00 % | 29.12.2049 | 191.664 | 0,30 |
| 400.000 | Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT** | 3,75 % | 30.03.2026 | 382.379 | 0,60 |
| 200.000 | Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT* | 4,30 % | 29.12.2049 | 177.706 | 0,28 |
| 600.000 | Bank of China Ltd** | 5,00 % | 13.11.2024 | 596.865 | 0,93 |
| 250.000 | Bank of East Asia Ltd* | 4,00 % | 29.05.2030 | 235.836 | 0,37 |
| 200.000 | BOC Aviation Ltd** | 1,75 % | 21.01.2026 | 187.113 | 0,29 |
| 200.000 | BOC Aviation Ltd* | 2,63 % | 17.09.2030 | 172.691 | 0,27 |
| 200.000 | BOC Aviation Ltd* | 3,00 % | 11.09.2029 | 180.011 | 0,28 |
| 200.000 | BOC Aviation Ltd** | 3,50 % | 10.10.2024 | 197.180 | 0,31 |
| 200.000 | BOC Aviation Ltd* | 4,50 % | 23.05.2028 | 196.350 | 0,31 |
| 200.000 | BOC Aviation USA Corp* | 1,63 % | 29.04.2024 | 197.483 | 0,31 |
| 200.000 | CAS Capital No 1 Ltd* | 4,00 % | 29.12.2049 | 172.920 | 0,27 |
| 200.000 | CCBL Cayman 1 Corp Ltd* | 1,80 % | 22.07.2026 | 185.173 | 0,29 |
| 400.000 | CCBL Cayman 1 Corp Ltd* | 1,99 % | 21.07.2025 | 381.249 | 0,60 |
| 400.000 | CDBL Funding 2* | 2,00 % | 04.03.2026 | 376.191 | 0,59 |
| 200.000 | Celestial Miles Ltd* | 5,75 % | 29.12.2049 | 199.600 | 0,31 |
| 200.000 | China Cinda Finance 2017 I Ltd* | 4,75 % | 08.02.2028 | 195.664 | 0,31 |
| 400.000 | China Cinda Finance 2017 I Ltd** | 4,75 % | 21.02.2029 | 388.612 | 0,61 |

Responsible Asian Debt – Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 71,46 % (31. Dezember 2022: 83,65 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 300.000 | China CITIC Bank International Ltd [†] | 6,00 % | 05.12.2033 | 307.518 | 0,48 |
| 600.000 | China Construction Bank Corp [†] | 2,45 % | 24.06.2030 | 574.605 | 0,90 |
| 400.000 | China Construction Bank Corp [†] | 4,50 % | 31.05.2026 | 397.795 | 0,62 |
| 200.000 | China Hongqiao Group Ltd [†] | 6,25 % | 08.06.2024 | 198.770 | 0,31 |
| 400.000 | China SCE Group Holdings Ltd ^{**} | 7,00 % | 02.05.2025 | 25.200 | 0,04 |
| 200.000 | CICC Hong Kong Finance 2016 MTN Ltd [†] | 5,49 % | 01.03.2026 | 201.893 | 0,32 |
| 300.000 | CK Hutchison International 17 II Ltd ^{**} | 3,25 % | 29.09.2027 | 284.505 | 0,44 |
| 200.000 | CK Hutchison International 21 Ltd [†] | 2,50 % | 15.04.2031 | 171.577 | 0,27 |
| 200.000 | CK Hutchison International 23 Ltd ^{**} | 4,75 % | 21.04.2028 | 200.395 | 0,31 |
| 390.000 | CK Hutchison International 23 Ltd ^{**} | 4,88 % | 21.04.2033 | 391.577 | 0,61 |
| 300.000 | CMB International Leasing Management Ltd [†] | 1,88 % | 12.08.2025 | 284.464 | 0,44 |
| 200.000 | CMHI Finance BVI Co Ltd [†] | 5,00 % | 06.08.2028 | 203.515 | 0,32 |
| 200.000 | Contemporary Ruiding Development Ltd [†] | 2,63 % | 17.09.2030 | 171.403 | 0,27 |
| 178.250 | Continuum Energy Levanter Pte Ltd ^{**} | 4,50 % | 09.02.2027 | 167.754 | 0,26 |
| 200.000 | DBS Group Holdings Ltd ^{**} | 1,82 % | 10.03.2031 | 185.518 | 0,29 |
| 200.000 | DBS Group Holdings Ltd [†] | 3,30 % | 29.12.2049 | 193.178 | 0,30 |
| 300.000 | DBS Group Holdings Ltd ^{**} | 5,48 % | 12.09.2025 | 303.651 | 0,47 |
| 800.000 | Dua Capital Ltd [†] | 2,78 % | 11.05.2031 | 697.587 | 1,09 |
| 200.000 | Elect Global Investments Ltd [†] | 4,10 % | 29.12.2049 | 176.000 | 0,28 |
| 800.000 | ENN Clean Energy International Investment Ltd [†] | 3,38 % | 12.05.2026 | 750.713 | 1,17 |
| 400.000 | ENN Energy Holdings Ltd ^{**} | 2,63 % | 17.09.2030 | 342.816 | 0,54 |
| 200.000 | Fortune Star BVI Ltd [†] | 5,95 % | 19.10.2025 | 166.737 | 0,26 |
| 200.000 | Franshion Brilliant Ltd [†] | 4,25 % | 23.07.2029 | 130.206 | 0,20 |
| 400.000 | GC Treasury Center Co Ltd [†] | 4,40 % | 30.03.2032 | 365.594 | 0,57 |
| 200.000 | Globe Telecom Inc [†] | 4,20 % | 29.12.2049 | 189.356 | 0,30 |
| 370.000 | Greenko Dutch BV ^{**} | 3,85 % | 29.03.2026 | 345.367 | 0,54 |
| 360.000 | Greenko Power II Ltd [†] | 4,30 % | 13.12.2028 | 325.440 | 0,50 |
| 200.000 | Greenko Solar Mauritius Ltd [†] | 5,95 % | 29.07.2026 | 193.900 | 0,30 |
| 200.000 | Hana Bank [†] | 3,25 % | 30.03.2027 | 191.297 | 0,30 |
| 200.000 | Hanwha Life Insurance Co Ltd ^{**} | 3,38 % | 04.02.2032 | 184.496 | 0,29 |
| 400.000 | HDFC Bank Ltd ^{**} | 3,70 % | 29.12.2049 | 365.019 | 0,57 |
| 200.000 | HKT Capital No 6 Ltd ^{**} | 3,00 % | 18.01.2032 | 172.411 | 0,27 |
| 200.000 | Horse Gallop Finance Ltd ^{**} | 1,10 % | 26.07.2024 | 195.379 | 0,31 |
| 200.000 | Huarong Finance 2019 Co Ltd [†] | 3,75 % | 29.05.2024 | 197.302 | 0,31 |
| 500.000 | Huarong Finance 2019 Co Ltd [†] | 4,50 % | 29.05.2029 | 443.425 | 0,69 |
| 650.000 | Huarong Finance II Co Ltd [†] | 5,50 % | 16.01.2025 | 644.313 | 1,01 |
| 200.000 | Hyundai Capital America ^{**} | 5,50 % | 30.03.2026 | 201.122 | 0,31 |

Responsible Asian Debt – Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 71,46 % (31. Dezember 2022: 83,65 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 400.000 | Hyundai Capital America** | 5,60 % | 30.03.2028 | 406.223 | 0,64 |
| 200.000 | Hyundai Capital America** | 5,68 % | 26.06.2028 | 203.999 | 0,32 |
| 200.000 | Indian Railway Finance Corp Ltd* | 2,80 % | 10.02.2031 | 172.329 | 0,27 |
| 200.000 | Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT** | 3,40 % | 09.06.2031 | 173.294 | 0,27 |
| 200.000 | Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT** | 3,54 % | 27.04.2032 | 173.230 | 0,27 |
| 600.000 | Industrial & Commercial Bank of China Ltd** | 4,88 % | 21.09.2025 | 595.320 | 0,93 |
| 200.000 | Inventive Global Investments Ltd* | 1,10 % | 01.09.2024 | 194.545 | 0,30 |
| 400.000 | JD.com Inc** | 3,38 % | 14.01.2030 | 361.984 | 0,57 |
| 402.500 | JSW Hydro Energy Ltd* | 4,13 % | 18.05.2031 | 351.135 | 0,55 |
| 500.000 | Kasikornbank PCL* | 3,34 % | 02.10.2031 | 460.180 | 0,72 |
| 200.000 | Kasikornbank PCL* | 5,46 % | 07.03.2028 | 204.012 | 0,32 |
| 200.000 | Khazanah Capital Ltd** | 4,88 % | 01.06.2033 | 201.092 | 0,31 |
| 400.000 | Kookmin Bank** | 2,50 % | 04.11.2030 | 333.370 | 0,52 |
| 200.000 | Krung Thai Bank PCL** | 4,40 % | 29.12.2049 | 186.020 | 0,29 |
| 200.000 | KT Corp* | 4,00 % | 08.08.2025 | 196.708 | 0,31 |
| 200.000 | Kyobo Life Insurance Co Ltd* | 5,90 % | 15.06.2052 | 198.600 | 0,31 |
| 200.000 | Lenovo Group Ltd* | 3,42 % | 02.11.2030 | 176.744 | 0,28 |
| 473.000 | Lenovo Group Ltd* | 5,83 % | 27.01.2028 | 482.739 | 0,76 |
| 200.000 | Lenovo Group Ltd* | 6,54 % | 27.07.2032 | 213.435 | 0,33 |
| 400.000 | LG Chem Ltd* | 2,38 % | 07.07.2031 | 331.350 | 0,52 |
| 200.000 | LG Energy Solution Ltd** | 5,75 % | 25.09.2028 | 206.295 | 0,32 |
| 200.000 | Link Finance Cayman 2009 Ltd* | 2,75 % | 19.01.2032 | 169.573 | 0,27 |
| 200.000 | Longfor Group Holdings Ltd** | 3,95 % | 16.09.2029 | 92.201 | 0,14 |
| 800.000 | Medco Bell Pte Ltd** | 6,38 % | 30.01.2027 | 762.250 | 1,19 |
| 200.000 | Medco Oak Tree Pte Ltd** | 7,38 % | 14.05.2026 | 198.832 | 0,31 |
| 300.000 | Meituan* | 3,05 % | 28.10.2030 | 253.434 | 0,40 |
| 200.000 | Metropolitan Bank & Trust Co** | 2,13 % | 15.01.2026 | 187.335 | 0,29 |
| 200.000 | MTR Corp Ltd** | 1,63 % | 19.08.2030 | 167.273 | 0,26 |
| 400.000 | Network i2i Ltd* | 5,65 % | 29.12.2049 | 396.172 | 0,62 |
| 400.000 | NWD Finance BVI Ltd* | 5,25 % | 29.12.2049 | 265.283 | 0,41 |
| 200.000 | Oversea-Chinese Banking Corp Ltd** | 1,83 % | 10.09.2030 | 188.208 | 0,29 |
| 200.000 | Oversea-Chinese Banking Corp Ltd* | 4,60 % | 15.06.2032 | 197.664 | 0,31 |
| 500.000 | Periama Holdings LLC* | 5,95 % | 19.04.2026 | 493.390 | 0,77 |
| 1.900.000 | Pertamina Persero PT* | 6,50 % | 27.05.2041 | 2.100.912 | 3,29 |
| 200.000 | Philippine National Bank** | 3,28 % | 27.09.2024 | 195.650 | 0,31 |
| 300.000 | Power Finance Corp Ltd* | 3,35 % | 16.05.2031 | 264.590 | 0,41 |
| 300.000 | Power Finance Corp Ltd* | 3,95 % | 23.04.2030 | 277.774 | 0,43 |
| 700.000 | Prudential Funding Asia Plc* | 2,95 % | 03.11.2033 | 616.486 | 0,96 |

Responsible Asian Debt – Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 71,46 % (31. Dezember 2022: 83,65 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 200.000 | PSA Treasury Pte Ltd* | 2,25 % | 30.04.2030 | 174.613 | 0,27 |
| 200.000 | REC Ltd* | 2,25 % | 01.09.2026 | 184.914 | 0,29 |
| 200.000 | REC Ltd** | 5,63 % | 11.04.2028 | 203.293 | 0,32 |
| 250.000 | Reliance Industries Ltd* | 2,88 % | 12.01.2032 | 214.370 | 0,34 |
| 500.000 | Reliance Industries Ltd* | 3,63 % | 12.01.2052 | 367.438 | 0,57 |
| 300.000 | Reliance Industries Ltd* | 4,13 % | 28.01.2025 | 296.352 | 0,46 |
| 800.000 | ReNew Wind Energy AP2/ReNew Power Pvt Ltd other 9 Subsidiaries** | 4,50 % | 14.07.2028 | 711.686 | 1,11 |
| 200.000 | RKPF Overseas 2020 A Ltd** | 5,20 % | 12.01.2026 | 52.148 | 0,08 |
| 200.000 | SF Holding Investment 2021 Ltd* | 2,38 % | 17.11.2026 | 185.892 | 0,29 |
| 422.000 | SF Holding Investment 2021 Ltd* | 3,13 % | 17.11.2031 | 366.680 | 0,57 |
| 300.000 | Shinhan Bank Co Ltd** | 3,88 % | 24.03.2026 | 290.026 | 0,45 |
| 400.000 | Shinhan Bank Co Ltd* | 4,38 % | 13.04.2032 | 370.846 | 0,58 |
| 200.000 | Shinhan Bank Co Ltd** | 4,50 % | 12.04.2028 | 198.516 | 0,31 |
| 200.000 | Shinhan Financial Group Co Ltd* | 3,34 % | 05.02.2030 | 194.910 | 0,30 |
| 325.000 | Shinhan Financial Group Co Ltd** | 5,00 % | 24.07.2028 | 325.095 | 0,51 |
| 500.000 | Shriram Finance Ltd* | 4,40 % | 13.03.2024 | 496.960 | 0,78 |
| 200.000 | Singapore Telecommunications Ltd** | 7,38 % | 01.12.2031 | 235.043 | 0,37 |
| 200.000 | Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd** | 4,75 % | 05.08.2029 | 13.500 | 0,02 |
| 400.000 | SK Battery America Inc** | 2,13 % | 26.01.2026 | 369.944 | 0,58 |
| 400.000 | SK Hynix Inc* | 2,38 % | 19.01.2031 | 324.685 | 0,51 |
| 200.000 | SK Hynix Inc* | 6,38 % | 17.01.2028 | 206.717 | 0,32 |
| 200.000 | SK Hynix Inc* | 6,50 % | 17.01.2033 | 211.311 | 0,33 |
| 200.000 | SK On Co Ltd** | 5,38 % | 11.05.2026 | 201.383 | 0,32 |
| 400.000 | Standard Chartered Plc* | 1,46 % | 14.01.2027 | 366.669 | 0,57 |
| 400.000 | Standard Chartered Plc* | 4,30 % | 29.12.2049 | 326.208 | 0,51 |
| 200.000 | Standard Chartered Plc** | 4,75 % | 29.12.2049 | 163.218 | 0,26 |
| 200.000 | Standard Chartered Plc* | 6,19 % | 06.07.2027 | 203.472 | 0,32 |
| 500.000 | Standard Chartered Plc* | 6,30 % | 06.07.2034 | 525.454 | 0,82 |
| 600.000 | Standard Chartered Plc* | 6,30 % | 09.01.2029 | 615.637 | 0,96 |
| 200.000 | Star Energy Geothermal Darajat II/Star Energy Geothermal Salak* | 4,85 % | 14.10.2038 | 183.417 | 0,29 |
| 162.160 | Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd** | 6,75 % | 24.04.2033 | 162.240 | 0,25 |
| 400.000 | State Bank of India* | 4,88 % | 05.05.2028 | 399.914 | 0,63 |
| 200.000 | Sun Hung Kai Properties Capital Market Ltd* | 2,75 % | 13.05.2030 | 174.226 | 0,27 |
| 200.000 | Sun Hung Kai Properties Capital Market Ltd** | 3,75 % | 25.02.2029 | 188.851 | 0,30 |
| 500.000 | Tencent Holdings Ltd* | 3,24 % | 03.06.2050 | 333.853 | 0,52 |
| 200.000 | Tencent Holdings Ltd* | 3,60 % | 19.01.2028 | 190.409 | 0,30 |
| 200.000 | Tencent Holdings Ltd** | 3,68 % | 22.04.2041 | 157.441 | 0,25 |
| 200.000 | Tencent Holdings Ltd* | 3,98 % | 11.04.2029 | 190.418 | 0,30 |

Responsible Asian Debt – Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 71,46 % (31. Dezember 2022: 83,65 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 400.000 | Thaioil Treasury Center Co Ltd* | 3,75 % | 18.06.2050 | 282.213 | 0,44 |
| 500.000 | TSMC Arizona Corp* | 1,75 % | 25.10.2026 | 461.090 | 0,72 |
| 400.000 | TSMC Arizona Corp* | 2,50 % | 25.10.2031 | 344.571 | 0,54 |
| 500.000 | TSMC Global Ltd* | 2,25 % | 23.04.2031 | 426.140 | 0,67 |
| 200.000 | United Overseas Bank Ltd* | 1,75 % | 16.03.2031 | 184.660 | 0,29 |
| 200.000 | United Overseas Bank Ltd* | 2,00 % | 14.10.2031 | 182.303 | 0,29 |
| 600.000 | United Overseas Bank Ltd* | 3,86 % | 07.10.2032 | 574.063 | 0,90 |
| 200.000 | Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd* | 3,98 % | 09.11.2027 | 134.710 | 0,21 |
| 600.000 | Vedanta Resources Finance II Plc* | 8,95 % | 11.03.2025 | 446.724 | 0,70 |
| 200.000 | Vedanta Resources Finance II Plc* | 13,88 % | 21.01.2024 | 176.756 | 0,28 |
| 200.000 | Woori Bank* | 4,75 % | 30.04.2024 | 199.362 | 0,31 |
| 200.000 | Yanlord Land HK Co Ltd** | 5,13 % | 20.05.2026 | 116.484 | 0,18 |
| Unternehmensanleihen insgesamt | | | | 45.692.223 | 71,46 |
| Staatsanleihen 18,81 % (31. Dezember 2022: 9,67 %) | | | | | |
| Euro | | | | | |
| 900.000 | Indonesia Government International Bond | 1,10 % | 12.03.2033 | 789.141 | 1,23 |
| 1.108.000 | Indonesia Government International Bond | 1,40 % | 30.10.2031 | 1.040.635 | 1,63 |
| 400.000 | Philippine Government International Bond | 1,20 % | 28.04.2033 | 355.787 | 0,56 |
| Euro insgesamt | | | | 2.185.563 | 3,42 |
| US-Dollar | | | | | |
| 200.000 | Airport Authority | 2,10 % | 29.12.2049 | 185.303 | 0,29 |
| 200.000 | Airport Authority | 2,40 % | 29.12.2049 | 177.654 | 0,28 |
| 400.000 | Airport Authority | 3,25 % | 12.01.2052 | 308.336 | 0,48 |
| 300.000 | Airport Authority | 4,88 % | 12.01.2033 | 307.876 | 0,48 |
| 200.000 | Export-Import Bank of India | 2,25 % | 13.01.2031 | 167.634 | 0,26 |
| 200.000 | Export-Import Bank of Korea | 4,50 % | 15.09.2032 | 199.915 | 0,31 |
| 600.000 | Export-Import Bank of Korea | 5,00 % | 11.01.2028 | 611.523 | 0,96 |
| 750.000 | Indonesia Government International Bond | 4,85 % | 11.01.2033 | 764.766 | 1,20 |
| 95.000 | Indonesia Government International Bond | 7,75 % | 17.01.2038 | 122.102 | 0,19 |
| 1.100.000 | Indonesia Government International Bond | 8,50 % | 12.10.2035 | 1.465.750 | 2,29 |
| 342.000 | Industrial Bank of Korea | 5,38 % | 04.10.2028 | 353.339 | 0,55 |
| 200.000 | Korea Development Bank | 4,38 % | 15.02.2028 | 199.136 | 0,31 |
| 200.000 | Korea Development Bank | 4,38 % | 15.02.2033 | 196.332 | 0,31 |
| 200.000 | Korea Gas Corp | 2,88 % | 16.07.2029 | 183.008 | 0,29 |
| 200.000 | Korea Gas Corp | 3,88 % | 13.07.2027 | 194.835 | 0,31 |
| 300.000 | Korea Gas Corp | 4,88 % | 05.07.2028 | 302.979 | 0,47 |

Responsible Asian Debt – Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 18,81 % (31. Dezember 2022: 9,67 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 200.000 | Korea Housing Finance Corp | 4,63 % | 24.02.2028 | 199.757 | 0,31 |
| 450.000 | Korea Land & Housing Corp | 5,75 % | 06.10.2025 | 455.328 | 0,71 |
| 200.000 | Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp | 1,75 % | 15.04.2026 | 184.811 | 0,29 |
| 400.000 | Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp | 5,38 % | 11.05.2028 | 404.394 | 0,63 |
| 650.000 | Mongolia Government International Bond | 8,65 % | 19.01.2028 | 682.050 | 1,07 |
| 500.000 | Philippine Government International Bond | 6,38 % | 23.10.2034 | 567.795 | 0,89 |
| 200.000 | Sri Lanka Government International Bond | 5,75 % | 18.04.2023 | 102.875 | 0,16 |
| 200.000 | Sri Lanka Government International Bond | 5,88 % | 25.07.2024 | 105.900 | 0,17 |
| 200.000 | Sri Lanka Government International Bond | 6,35 % | 28.06.2024 | 101.861 | 0,16 |
| 1.000.000 | Sri Lanka Government International Bond | 6,83 % | 18.07.2026 | 514.396 | 0,80 |
| 800.000 | Sri Lanka Government International Bond | 6,85 % | 14.03.2024 | 407.380 | 0,64 |
| 720.000 | Sri Lanka Government International Bond | 6,85 % | 03.11.2025 | 372.598 | 0,58 |
| US-Dollar insgesamt | | | | 9.839.633 | 15,39 |
| Staatsanleihen insgesamt * | | | | 12.025.196 | 18,81 |
| Anlagen insgesamt | | | | 60.214.155 | 94,17 |

Devisenterminkontrakte 0,20 % (31. Dezember 2022: 0,16 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeits- datum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Netto- vermögens |
|---|------------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------------|---------------------------|
| 4.843.308.714 IDR | 306.976 US\$ | 07.02.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 7.164 | 0,01 |
| 25.391.445 INR | 304.372 US\$ | 08.02.2024 | Citibank NA | 1 | 272 | 0,00 |
| 60.196.663 KRW | 46.083 US\$ | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | 553 | 0,00 |
| 415.499.493 KRW | 315.322 US\$ | 16.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 5.244 | 0,01 |
| 817.357.899 KRW | 626.191 US\$ | 20.03.2024 | UBS AG | 1 | 7.037 | 0,01 |
| 1.434.521 MYR | 307.323 US\$ | 11.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 5.594 | 0,01 |
| 1.447.850 MYR | 306.469 US\$ | 23.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 9.639 | 0,01 |
| 2.874.947 MYR | 620.069 US\$ | 07.03.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 9.840 | 0,02 |
| 17.227.946 PHP | 307.576 US\$ | 06.02.2024 | Morgan Stanley | 1 | 3.429 | 0,01 |
| 416.971 SGD | 306.582 US\$ | 22.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 9.816 | 0,02 |
| 11.121.999 THB | 311.200 US\$ | 16.01.2024 | BNP Paribas | 1 | 15.028 | 0,02 |
| 40.110 THB | 1.151 US\$ | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | 32 | 0,00 |
| 40.111 THB | 1.153 US\$ | 20.03.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 30 | 0,00 |
| 21.835.494 THB | 622.484 US\$ | 08.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 17.498 | 0,03 |
| 19.649.022 TWD | 617.888 US\$ | 12.01.2024 | Citibank NA | 1 | 26.830 | 0,04 |
| 9.804.377 TWD | 312.969 US\$ | 08.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 8.007 | 0,01 |
| 79.042 US\$ | 101.151.334 KRW | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | 677 | 0,00 |
| 327.152 US\$ | 423.563.202 KRW | 16.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 365 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ** | | | | | 127.055 | 0,20 |

Responsible Asian Debt – Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Futures-Kontrakte 0,40 % (31. Dezember 2022: 0,22 %)

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|--|--------------------------------|----------------------|
| 2 | South Korea 10-Year Bond Future March 2024 | 2.376 | 0,00 |
| 28 | South Korea 3-Year Bond Future March 2024 | 6.957 | 0,01 |
| 22 | US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2024 | 246.525 | 0,39 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten * | | 255.858 | 0,40 |

Zinsswap-Kontrakte 0,00 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)

| Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei | Erhalt/(Zahlung)# | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|------------|-------------------------------|-------------------|-----------------|--------------------|--------------------------------|----------------------|
| CNY 4.000.000 | 11.12.2026 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 2,25 % | 7D CNRR | 408 | 0,00 |
| MYR 3.947.651 | 20.12.2025 | Goldman Sachs International | (Zahlung) | 3,50 % | 3M KLIBOR | 167 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten [∞] | | | | | | 575 | 0,00 |

#Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

¹Zentral abgewickelter Swap.

| | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|-------------------|----------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 60.597.643 | 94,77 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,21 %) (31. Dezember 2022: (0,39 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 4.444.712 CNH | 624.696 US\$ | 10.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | (167) | (0,00) |
| 303.185 US\$ | 413.233 SGD | 22.01.2024 | Citibank NA | 1 | (10.376) | (0,02) |
| 61 US\$ | 943.992 IDR | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | 0 | (0,00) |
| 15.818 US\$ | 112.327 CNH | 20.03.2024 | Citibank NA | 2 | (41) | (0,00) |
| 301.188 US\$ | 1.426.727 MYR | 23.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (10.309) | (0,02) |
| 650.052 US\$ | 4.679.539 CNY | 20.02.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (9.333) | (0,01) |
| 2.057.426 US\$ | 1.898.111 € | 20.03.2024 | Morgan Stanley | 2 | (45.904) | (0,07) |
| 329.691 US\$ | 11.501.334 THB | 16.01.2024 | Morgan Stanley | 1 | (7.664) | (0,01) |
| 612.078 US\$ | 4.462.403 CNY | 10.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | (14.937) | (0,02) |
| 615.648 US\$ | 19.709.861 TWD | 12.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | (31.066) | (0,05) |
| 324.864 US\$ | 10.075.769 TWD | 08.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | (4.997) | (0,01) |
| 47.872 US\$ | 62.483.796 KRW | 20.03.2024 | UBS AG | 2 | (536) | (0,00) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | (135.330) | (0,21) |

Responsible Asian Debt – Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Futures-Kontrakte (0,20 %) (31. Dezember 2022: (0,02 %))

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|--|---------------------------------|----------------------|
| (14) | Euro-Bund Future March 2024 | (76.950) | (0,12) |
| (16) | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2024 | (51.163) | (0,08) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten * | | (128.113) | (0,20) |

Zinsswap-Kontrakte (0,00 %) (31. Dezember 2022: (0,00 %))

| Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei | Erhalt/(Zahlung)# | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|------------|-------------------------------|-------------------|-----------------|--------------------|---------------------------------|----------------------|
| INR 62.801.395 | 19.12.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 6,21 % | 1D MIBOR | (21) | (0,00) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten [∞] | | | | | | (21) | (0,00) |

#Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

¹Zentral abgewickelter Swap.

| | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|---|-------------------|----------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (263.464) | (0,41) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | 60.334.179 | 94,36 |
| Sonstiges Nettovermögen | 3.607.685 | 5,64 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | 63.941.864 | 100,00 |

| Portfolioanalyse | US\$ | % des Gesamtvermögens |
|---|-------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 43.291.945 | 67,34 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 16.922.210 | 26,32 |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 127.745 | 0,20 |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap | (7.721) | (0,01) |
| Anlagen insgesamt | 60.334.179 | 93,85 |

Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|--|--|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Schatzwechsel 1,36 % (31. Dezember 2022: 1,00 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 55.000.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 23.05.2024 | 53.894.704 | 1,36 |
| Schatzwechsel insgesamt ** | | | | 53.894.704 | 1,36 |
| Unternehmensanleihen 60,85 % (31. Dezember 2022: 68,84 %) | | | | | |
| Euro | | | | | |
| 15.300.000 | NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance Plc* | 7,13 % | 19.07.2026 | 8.023.480 | 0,20 |
| 2.000.000 | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara* | 2,88 % | 25.10.2025 | 2.172.045 | 0,06 |
| Euro insgesamt | | | | 10.195.525 | 0,26 |
| US-Dollar | | | | | |
| 21.380.000 | ABQ Finance Ltd* | 1,88 % | 08.09.2025 | 20.039.816 | 0,51 |
| 12.477.000 | ABQ Finance Ltd* | 2,00 % | 06.07.2026 | 11.460.998 | 0,29 |
| 9.283.000 | ABQ Finance Ltd* | 3,13 % | 24.09.2024 | 9.116.983 | 0,23 |
| 12.926.000 | Abu Dhabi Commercial Bank PJSC* | 3,50 % | 31.03.2027 | 12.316.694 | 0,31 |
| 5.370.000 | Abu Dhabi Commercial Bank PJSC* | 4,50 % | 14.09.2027 | 5.284.375 | 0,13 |
| 10.000.000 | Abu Dhabi Commercial Bank PJSC* | 5,38 % | 18.07.2028 | 10.158.510 | 0,26 |
| 5.799.000 | Abu Dhabi Commercial Bank PJSC* | 5,50 % | 12.01.2029 | 5.918.941 | 0,15 |
| 6.713.000 | Abu Dhabi National Energy Co PJSC* | 4,38 % | 24.01.2029 | 6.682.187 | 0,17 |
| 4.324.000 | Access Bank Plc* | 6,13 % | 21.09.2026 | 3.903.059 | 0,10 |
| 6.409.000 | Adani Green Energy Ltd* | 4,38 % | 08.09.2024 | 6.192.402 | 0,16 |
| 14.357.000 | Adani Green Energy UP Ltd/Prayatna Developers Pvt Ltd/Parampujya Solar Energy* | 6,25 % | 10.12.2024 | 14.204.768 | 0,36 |
| 496.000 | Adani Ports & Special Economic Zone Ltd** | 3,38 % | 24.07.2024 | 486.436 | 0,01 |
| 7.758.000 | Africa Finance Corp* | 3,88 % | 13.04.2024 | 7.704.803 | 0,19 |
| 8.509.000 | African Export-Import Bank* | 2,63 % | 17.05.2026 | 7.869.123 | 0,20 |
| 7.500.000 | African Export-Import Bank* | 4,13 % | 20.06.2024 | 7.434.675 | 0,19 |
| 3.589.000 | AIA Group Ltd* | 5,63 % | 25.10.2027 | 3.704.094 | 0,09 |
| 2.000.000 | Alibaba Group Holding Ltd* | 3,40 % | 06.12.2027 | 1.897.674 | 0,05 |
| 10.941.000 | Alsea SAB de CV** | 7,75 % | 14.12.2026 | 11.179.426 | 0,28 |
| 5.000.000 | Arabian Centres Sukuk II Ltd* | 5,63 % | 07.10.2026 | 4.588.500 | 0,12 |
| 6.540.000 | AUB Sukuk Ltd* | 2,62 % | 09.09.2026 | 6.004.963 | 0,15 |
| 2.119.000 | Azul Secured Finance LLP** | 11,93 % | 28.08.2028 | 2.194.061 | 0,06 |
| 2.552.000 | Baidu Inc** | 1,72 % | 09.04.2026 | 2.370.640 | 0,06 |
| 12.828.000 | Banco Bradesco SA* | 3,20 % | 27.01.2025 | 12.465.495 | 0,32 |
| 10.992.000 | Banco Bradesco SA** | 4,38 % | 18.03.2027 | 10.690.209 | 0,27 |
| 13.882.000 | Banco BTG Pactual SA* | 2,75 % | 11.01.2026 | 13.117.783 | 0,33 |
| 7.781.000 | Banco BTG Pactual SA* | 4,50 % | 10.01.2025 | 7.650.320 | 0,19 |
| 5.800.000 | Banco BTG Pactual SA Series JUL* | 4,50 % | 10.01.2025 | 5.702.591 | 0,14 |
| 11.000.000 | Banco de Bogota SA* | 6,25 % | 12.05.2026 | 10.869.478 | 0,27 |
| 10.400.000 | Banco de Credito del Peru SA** | 2,70 % | 11.01.2025 | 10.101.763 | 0,26 |

Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 60,85 % (31. Dezember 2022: 68,84 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 10.245.000 | Banco do Brasil SA* | 3,25 % | 30.09.2026 | 9.735.038 | 0,24 |
| 13.000.000 | Banco Inbursa SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Inbursa* | 4,13 % | 06.06.2024 | 12.879.636 | 0,33 |
| 9.000.000 | Banco Nacional de Comercio Exterior SNC* | 2,72 % | 11.08.2031 | 7.690.299 | 0,19 |
| 6.297.000 | Banco Santander Chile** | 2,70 % | 10.01.2025 | 6.129.153 | 0,15 |
| 17.442.000 | Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand** | 5,38 % | 17.04.2025 | 17.424.605 | 0,44 |
| 8.824.000 | Banco Votorantim SA** | 4,50 % | 24.09.2024 | 8.678.877 | 0,22 |
| 10.200.000 | Bancolombia SA* | 6,91 % | 18.10.2027 | 10.202.213 | 0,26 |
| 4.931.000 | Bangkok Bank PCL* | 4,30 % | 15.06.2027 | 4.834.724 | 0,12 |
| 3.241.000 | Bank Mandiri Persero Tbk PT** | 4,75 % | 13.05.2025 | 3.220.793 | 0,08 |
| 9.789.000 | Bank Muscat SAOG* | 4,75 % | 17.03.2026 | 9.605.061 | 0,24 |
| 3.832.000 | Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT** | 3,75 % | 30.03.2026 | 3.666.387 | 0,09 |
| 2.800.000 | Banque Ouest Africaine de Developpement* | 5,00 % | 27.07.2027 | 2.614.150 | 0,07 |
| 8.833.000 | BBK BSC* | 5,50 % | 09.07.2024 | 8.782.617 | 0,22 |
| 5.338.000 | Beijing Gas Singapore Capital Corp* | 1,88 % | 18.01.2025 | 5.156.607 | 0,13 |
| 5.677.000 | Bidvest Group UK Plc* | 3,63 % | 23.09.2026 | 5.279.610 | 0,13 |
| 21.303.017 | Bioceanico Sovereign Certificate Ltd* | 0,00 % | 05.06.2034 | 15.263.793 | 0,39 |
| 17.184.000 | Black Sea Trade & Development Bank* | 3,50 % | 25.06.2024 | 16.658.909 | 0,42 |
| 8.457.000 | BOC Aviation Ltd** | 1,75 % | 21.01.2026 | 7.916.989 | 0,20 |
| 3.487.000 | BOC Aviation Ltd* | 3,25 % | 29.04.2025 | 3.393.840 | 0,09 |
| 200.000 | BOC Aviation Ltd** | 3,50 % | 18.09.2027 | 190.350 | 0,00 |
| 5.399.000 | BOC Aviation Ltd** | 4,00 % | 25.01.2024 | 5.393.277 | 0,14 |
| 5.432.000 | BOCOM International Blossom Ltd* | 1,75 % | 28.06.2026 | 4.997.100 | 0,13 |
| 3.000.000 | Borr IHC Ltd/Borr Finance LLC** | 10,00 % | 15.11.2028 | 3.135.000 | 0,08 |
| 3.399.000 | Boubyan Sukuk Ltd** | 2,59 % | 18.02.2025 | 3.290.528 | 0,08 |
| 8.625.000 | Boubyan Sukuk Ltd* | 3,39 % | 29.03.2027 | 8.238.557 | 0,21 |
| 49.556.000 | Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais** | 5,33 % | 15.02.2028 | 48.829.013 | 1,23 |
| 17.430.000 | BSF Finance* | 5,50 % | 23.11.2027 | 17.713.238 | 0,45 |
| 25.742.000 | CBQ Finance Ltd* | 2,00 % | 15.09.2025 | 24.238.152 | 0,61 |
| 24.369.000 | CBQ Finance Ltd* | 2,00 % | 12.05.2026 | 22.494.036 | 0,57 |
| 4.800.000 | CCBL Cayman 1 Corp Ltd* | 1,60 % | 15.09.2026 | 4.397.994 | 0,11 |
| 6.549.000 | CCBL Cayman 1 Corp Ltd* | 1,99 % | 21.07.2025 | 6.244.978 | 0,16 |
| 9.000.000 | CDBL Funding 2* | 2,00 % | 04.03.2026 | 8.464.301 | 0,21 |
| 7.200.000 | Cencosud SA* | 4,38 % | 17.07.2027 | 6.951.352 | 0,18 |
| 3.439.000 | Centrais Eletricas Brasileiras SA** | 3,63 % | 04.02.2025 | 3.330.340 | 0,08 |
| 7.800.000 | Central American Bank for Economic Integration* | 1,14 % | 09.02.2026 | 7.179.053 | 0,18 |
| 12.476.000 | Central American Bank for Economic Integration* | 5,00 % | 09.02.2026 | 12.479.803 | 0,32 |
| 4.926.000 | Chalco Hong Kong Investment Co Ltd** | 1,55 % | 28.07.2024 | 4.818.163 | 0,12 |
| 4.399.000 | China Cinda Finance 2015 I Ltd* | 4,25 % | 23.04.2025 | 4.326.175 | 0,11 |
| 7.036.000 | China Construction Bank Corp* | 1,25 % | 04.08.2025 | 6.641.954 | 0,17 |

Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 60,85 % (31. Dezember 2022: 68,84 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 2.709.000 | China Hongqiao Group Ltd* | 6,25 % | 08.06.2024 | 2.690.112 | 0,07 |
| 24.471.000 | China Huadian Overseas Development 2018 Ltd* | 3,38 % | 29.12.2049 | 23.568.020 | 0,60 |
| 9.108.000 | China Huadian Overseas Development Management Co Ltd* | 4,00 % | 29.12.2049 | 9.031.851 | 0,23 |
| 4.090.000 | China Overseas Grand Oceans Finance IV Cayman Ltd* | 2,45 % | 09.02.2026 | 3.415.150 | 0,09 |
| 6.237.000 | CICC Hong Kong Finance 2016 MTN Ltd* | 2,00 % | 26.01.2026 | 5.880.713 | 0,15 |
| 4.600.000 | CITIC Ltd** | 2,88 % | 17.02.2027 | 4.357.782 | 0,11 |
| 4.303.000 | CITIC Securities Finance MTN Co Ltd* | 2,00 % | 03.06.2025 | 4.123.726 | 0,10 |
| 9.695.000 | CK Hutchison International 23 Ltd** | 4,75 % | 21.04.2028 | 9.714.127 | 0,25 |
| 4.000.000 | CMB International Leasing Management Ltd* | 1,25 % | 16.09.2024 | 3.884.349 | 0,10 |
| 11.236.000 | CMB International Leasing Management Ltd* | 1,88 % | 12.08.2025 | 10.659.344 | 0,27 |
| 2.500.000 | CMB International Leasing Management Ltd* | 2,00 % | 04.02.2026 | 2.338.625 | 0,06 |
| 12.815.000 | CMHI Finance BVI Co Ltd** | 4,00 % | 01.06.2027 | 12.541.746 | 0,32 |
| 9.392.000 | CNCBINV 1 BVI Ltd* | 1,75 % | 17.11.2024 | 9.074.034 | 0,23 |
| 43.930.000 | Comision Federal de Electricidad* | 4,69 % | 15.05.2029 | 41.389.866 | 1,05 |
| 14.467.000 | Commercial Bank of Dubai PSC* | 5,32 % | 14.06.2028 | 14.456.859 | 0,37 |
| 6.871.000 | Compania de Minas Buenaventura SAA** | 5,50 % | 23.07.2026 | 6.565.528 | 0,17 |
| 23.570.000 | Corp Andina de Fomento* | 1,25 % | 26.10.2024 | 22.795.855 | 0,58 |
| 27.333.000 | Corp Andina de Fomento* | 2,25 % | 08.02.2027 | 25.051.374 | 0,63 |
| 15.367.000 | Corp Andina de Fomento* | 6,00 % | 26.04.2027 | 15.899.103 | 0,40 |
| 3.528.000 | Credicorp Ltd** | 2,75 % | 17.06.2025 | 3.366.801 | 0,09 |
| 3.800.000 | CSCIF Asia Ltd* | 1,75 % | 04.08.2025 | 3.603.188 | 0,09 |
| 15.200.000 | CSN Inova Ventures** | 6,75 % | 28.01.2028 | 14.862.723 | 0,38 |
| 2.000.000 | DBS Group Holdings Ltd** | 5,48 % | 12.09.2025 | 2.024.340 | 0,05 |
| 14.584.000 | DIB Sukuk Ltd* | 1,96 % | 22.06.2026 | 13.570.508 | 0,34 |
| 6.741.000 | DIB Sukuk Ltd* | 2,74 % | 16.02.2027 | 6.305.785 | 0,16 |
| 4.758.000 | DIB Sukuk Ltd* | 2,95 % | 20.02.2025 | 4.619.219 | 0,12 |
| 22.946.000 | DIB Sukuk Ltd* | 2,95 % | 16.01.2026 | 22.005.879 | 0,56 |
| 12.489.000 | DIB Sukuk Ltd* | 4,80 % | 16.08.2028 | 12.401.839 | 0,31 |
| 13.584.000 | DIB Sukuk Ltd* | 5,49 % | 30.11.2027 | 13.857.541 | 0,35 |
| 42.143.000 | Eastern & Southern African Trade & Development Bank* | 4,88 % | 23.05.2024 | 41.699.234 | 1,05 |
| 24.300.000 | Ecopetrol SA* | 5,38 % | 26.06.2026 | 23.842.591 | 0,60 |
| 20.000.000 | Ecopetrol SA** | 8,63 % | 19.01.2029 | 21.339.160 | 0,54 |
| 18.300.000 | El Sukuk Co Ltd** | 1,83 % | 23.09.2025 | 17.188.367 | 0,43 |
| 5.800.000 | El Sukuk Co Ltd* | 2,08 % | 02.11.2026 | 5.331.082 | 0,13 |
| 27.420.000 | Emirates Development Bank PJSC* | 1,64 % | 15.06.2026 | 25.147.814 | 0,64 |
| 21.200.000 | Emirates Development Bank PJSC* | 3,52 % | 06.03.2024 | 21.126.394 | 0,53 |
| 9.165.000 | Emirates NBD Bank PJSC** | 1,64 % | 13.01.2026 | 8.524.092 | 0,22 |
| 10.376.000 | Emirates NBD Bank PJSC** | 2,63 % | 18.02.2025 | 10.076.341 | 0,25 |
| 7.328.000 | Emirates NBD Bank PJSC* | 5,63 % | 21.10.2027 | 7.457.083 | 0,19 |
| 9.603.000 | Emirates NBD Bank PJSC* | 5,88 % | 11.10.2028 | 9.939.489 | 0,25 |

Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 60,85 % (31. Dezember 2022: 68,84 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 4.145.000 | Endeavour Mining Plc** | 5,00 % | 14.10.2026 | 3.841.918 | 0,10 |
| 1.500.000 | Energian Israel Finance Ltd** | 4,88 % | 30.03.2026 | 1.386.375 | 0,04 |
| 10.800.000 | ENN Clean Energy International Investment Ltd* | 3,38 % | 12.05.2026 | 10.134.627 | 0,26 |
| 11.568.000 | Fab Sukuk Co Ltd* | 1,41 % | 14.01.2026 | 10.748.118 | 0,27 |
| 8.577.000 | Fab Sukuk Co Ltd* | 3,88 % | 22.01.2024 | 8.567.874 | 0,22 |
| 15.000.000 | First Abu Dhabi Bank PJSC* | 4,38 % | 24.04.2028 | 14.735.445 | 0,37 |
| 26.439.000 | First Abu Dhabi Bank PJSC* | 5,13 % | 13.10.2027 | 26.668.998 | 0,67 |
| 6.633.000 | Franshion Brilliant Ltd* | 3,20 % | 09.04.2026 | 5.604.358 | 0,14 |
| 11.143.000 | FS Luxembourg Sarl** | 10,00 % | 15.12.2025 | 11.435.103 | 0,29 |
| 11.000.000 | Geopark Ltd** | 5,50 % | 17.01.2027 | 9.749.769 | 0,25 |
| 6.641.500 | Greenko Dutch BV** | 3,85 % | 29.03.2026 | 6.199.343 | 0,16 |
| 7.790.000 | Greenko Wind Projects Mauritius Ltd** | 5,50 % | 06.04.2025 | 7.638.095 | 0,19 |
| 16.370.000 | Grupo de Inversiones Suramericana SA* | 5,50 % | 29.04.2026 | 16.084.083 | 0,41 |
| 30.576.000 | Gulf International Bank BSC* | 2,38 % | 23.09.2025 | 28.690.928 | 0,73 |
| 4.200.000 | Haitong International Securities Group Ltd* | 3,13 % | 18.05.2025 | 4.053.588 | 0,10 |
| 8.395.000 | Hana Bank* | 3,25 % | 30.03.2027 | 8.029.697 | 0,20 |
| 1.551.000 | Hengjian International Investment Ltd** | 1,88 % | 23.06.2025 | 1.476.765 | 0,04 |
| 13.693.000 | Hikma Finance USA LLC* | 3,25 % | 09.07.2025 | 13.142.541 | 0,33 |
| 4.995.000 | Horse Gallop Finance Ltd* | 1,70 % | 28.07.2025 | 4.725.309 | 0,12 |
| 5.000.000 | HPHT Finance 19 Ltd** | 2,88 % | 05.11.2024 | 4.897.850 | 0,12 |
| 8.250.000 | HPHT Finance 21 II Ltd** | 1,50 % | 17.09.2026 | 7.522.309 | 0,19 |
| 7.365.000 | Huarong Finance 2019 Co Ltd* | 3,25 % | 13.11.2024 | 7.144.050 | 0,18 |
| 7.858.000 | Huarong Finance 2019 Co Ltd* | 3,75 % | 29.05.2024 | 7.751.996 | 0,20 |
| 2.400.000 | Huarong Finance II Co Ltd* | 5,50 % | 16.01.2025 | 2.379.000 | 0,06 |
| 1.000.000 | Hyundai Capital America** | 1,65 % | 17.09.2026 | 909.275 | 0,02 |
| 6.100.000 | Hyundai Capital America** | 2,65 % | 10.02.2025 | 5.922.168 | 0,15 |
| 6.097.000 | Hyundai Capital America** | 5,50 % | 30.03.2026 | 6.131.205 | 0,15 |
| 9.805.000 | Hyundai Capital America** | 5,68 % | 26.06.2028 | 10.001.075 | 0,25 |
| 5.000.000 | Hyundai Capital America** | 5,95 % | 21.09.2026 | 5.087.324 | 0,13 |
| 5.400.000 | IHS Holding Ltd** | 5,63 % | 29.11.2026 | 4.714.119 | 0,12 |
| 6.200.000 | IHS Netherlands Holdco BV** | 8,00 % | 18.09.2027 | 5.542.552 | 0,14 |
| 4.000.000 | Inventive Global Investments Ltd* | 1,10 % | 01.09.2024 | 3.890.900 | 0,10 |
| 6.467.000 | Israel Discount Bank Ltd** | 5,38 % | 26.01.2028 | 6.293.089 | 0,16 |
| 2.031.000 | Itau Unibanco Holding SA** | 3,25 % | 24.01.2025 | 1.976.659 | 0,05 |
| 7.411.000 | JBS USA LUX SA/JBS USA Food Co/JBS USA Finance Inc** | 2,50 % | 15.01.2027 | 6.824.679 | 0,17 |
| 3.996.000 | JBS USA LUX SA/JBS USA Food Co/JBS USA Finance Inc** | 5,13 % | 01.02.2028 | 3.976.324 | 0,10 |
| 7.877.000 | JSW Steel Ltd** | 5,95 % | 18.04.2024 | 7.847.931 | 0,20 |
| 8.439.000 | Kallpa Generacion SA* | 4,13 % | 16.08.2027 | 8.072.824 | 0,20 |
| 4.081.000 | Kasikornbank PCL* | 5,46 % | 07.03.2028 | 4.162.865 | 0,11 |
| 13.132.000 | KazMunayGas National Co JSC* | 4,75 % | 19.04.2027 | 12.797.068 | 0,32 |

Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 60,85 % (31. Dezember 2022: 68,84 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 7.000.000 | KOC Holding AS* | 6,50 % | 11.03.2025 | 6.984.775 | 0,18 |
| 6.079.000 | Kookmin Bank* | 1,38 % | 06.05.2026 | 5.570.015 | 0,14 |
| 5.500.000 | Kosmos Energy Ltd* | 7,13 % | 04.04.2026 | 5.248.687 | 0,13 |
| 2.775.000 | KT Corp* | 4,00 % | 08.08.2025 | 2.729.318 | 0,07 |
| 3.151.000 | Legend Fortune Ltd* | 1,38 % | 02.06.2024 | 3.099.746 | 0,08 |
| 3.500.000 | Lenovo Group Ltd* | 5,83 % | 27.01.2028 | 3.572.066 | 0,09 |
| 2.000.000 | Levc Finance Ltd** | 1,38 % | 25.03.2024 | 1.981.230 | 0,05 |
| 17.134.226 | Leviathan Bond Ltd* | 6,13 % | 30.06.2025 | 16.656.181 | 0,42 |
| 2.939.000 | LG Energy Solution Ltd** | 5,75 % | 25.09.2028 | 3.031.509 | 0,08 |
| 3.200.000 | Longfor Group Holdings Ltd* | 4,50 % | 16.01.2028 | 1.668.083 | 0,04 |
| 15.456.000 | Mashreqbank PSC* | 4,25 % | 26.02.2024 | 15.443.172 | 0,39 |
| 20.500.000 | MDGH GMTN RSC Ltd* | 2,50 % | 07.11.2024 | 20.000.518 | 0,51 |
| 6.800.000 | MDGH GMTN RSC Ltd* | 3,00 % | 19.04.2024 | 6.749.428 | 0,17 |
| 14.708.000 | MDGH GMTN RSC Ltd* | 3,00 % | 28.03.2027 | 13.958.260 | 0,35 |
| 4.417.000 | Medco Bell Pte Ltd** | 6,38 % | 30.01.2027 | 4.208.570 | 0,11 |
| 10.200.000 | MEGlobal Canada ULC* | 5,00 % | 18.05.2025 | 10.097.490 | 0,26 |
| 4.265.000 | Meituan* | 2,13 % | 28.10.2025 | 4.014.272 | 0,10 |
| 4.638.000 | Melco Resorts Finance Ltd** | 4,88 % | 06.06.2025 | 4.502.663 | 0,11 |
| 8.678.000 | Melco Resorts Finance Ltd* | 5,25 % | 26.04.2026 | 8.373.012 | 0,21 |
| 2.322.000 | MercadoLibre Inc** | 2,38 % | 14.01.2026 | 2.170.047 | 0,05 |
| 5.913.000 | Mersin Uluslararası Liman İşletmeciliği AS* | 8,25 % | 15.11.2028 | 6.181.864 | 0,16 |
| 2.200.000 | MGM China Holdings Ltd* | 5,25 % | 18.06.2025 | 2.162.328 | 0,05 |
| 11.983.000 | Minera y Metalurgica del Boleo SAPI de CV* | 3,25 % | 17.04.2024 | 11.907.131 | 0,30 |
| 12.721.000 | NBK SPC Ltd* | 1,63 % | 15.09.2027 | 11.535.950 | 0,29 |
| 11.700.000 | Nexa Resources SA** | 5,38 % | 04.05.2027 | 11.430.875 | 0,29 |
| 12.646.000 | NPC Ukrenargo* | 6,88 % | 09.11.2028 | 3.556.055 | 0,09 |
| 9.038.000 | Periana Holdings LLC* | 5,95 % | 19.04.2026 | 8.927.185 | 0,23 |
| 8.100.000 | Petrobras Global Finance BV* | 6,00 % | 27.01.2028 | 8.240.154 | 0,21 |
| 42.992.000 | Petroleos Mexicanos** | 6,50 % | 13.03.2027 | 40.104.696 | 1,01 |
| 5.920.000 | Philippine National Bank** | 3,28 % | 27.09.2024 | 5.791.269 | 0,15 |
| 9.364.000 | POSCO* | 4,38 % | 04.08.2025 | 9.231.060 | 0,23 |
| 3.931.000 | POSCO** | 5,75 % | 17.01.2028 | 4.035.688 | 0,10 |
| 5.571.000 | Powerchina Roadbridge Group British Virgin Islands Ltd** | 3,08 % | 29.12.2049 | 5.243.147 | 0,13 |
| 2.000.000 | Prosus NV* | 3,26 % | 19.01.2027 | 1.848.732 | 0,05 |
| 8.561.000 | QIB Sukuk Ltd* | 1,95 % | 27.10.2025 | 8.064.899 | 0,20 |
| 6.661.000 | QIB Sukuk Ltd* | 3,98 % | 26.03.2024 | 6.627.195 | 0,17 |
| 41.347.000 | QNB Finance Ltd* | 2,63 % | 12.05.2025 | 39.767.462 | 1,01 |
| 15.190.000 | QNB Finance Ltd* | 3,50 % | 28.03.2024 | 15.111.787 | 0,38 |
| 6.700.000 | Rakfunding Cayman Ltd* | 4,13 % | 09.04.2024 | 6.666.225 | 0,17 |
| 8.504.220 | Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co Ltd 3** | 5,84 % | 30.09.2027 | 8.626.936 | 0,22 |

Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 60,85 % (31. Dezember 2022: 68,84 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 16.989.800 | Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co Ltd 3** | 6,33 % | 30.09.2027 | 17.342.947 | 0,44 |
| 3.385.000 | REC Ltd* | 3,38 % | 25.07.2024 | 3.344.150 | 0,08 |
| 14.625.000 | REC Ltd* | 3,50 % | 12.12.2024 | 14.349.595 | 0,36 |
| 5.000.000 | Republic of Angola Via Avenir Issuer II Ireland DAC* | 6,93 % | 19.02.2027 | 4.662.500 | 0,12 |
| 20.000.000 | SA Global Sukuk Ltd* | 1,60 % | 17.06.2026 | 18.586.700 | 0,47 |
| 5.000.000 | Sands China Ltd** | 4,30 % | 08.01.2026 | 4.804.923 | 0,12 |
| 4.799.000 | Sands China Ltd* | 5,38 % | 08.08.2025 | 4.735.647 | 0,12 |
| 1.000.000 | Sands China Ltd** | 5,65 % | 08.08.2028 | 992.274 | 0,03 |
| 29.650.000 | Sasol Financing USA LLC* | 5,88 % | 27.03.2024 | 29.495.233 | 0,75 |
| 8.000.000 | Sasol Financing USA LLC* | 6,50 % | 27.09.2028 | 7.629.865 | 0,19 |
| 2.319.000 | Saudi Arabian Oil Co* | 1,63 % | 24.11.2025 | 2.184.885 | 0,06 |
| 30.986.000 | Saudi Arabian Oil Co* | 2,88 % | 16.04.2024 | 30.722.929 | 0,78 |
| 20.331.000 | Saudi Electricity Global Sukuk Co 4* | 4,22 % | 27.01.2024 | 20.324.941 | 0,51 |
| 22.370.000 | Saudi Electricity Global Sukuk Co 5* | 1,74 % | 17.09.2025 | 21.200.921 | 0,54 |
| 3.000.000 | SEPLAT Energy Plc* | 7,75 % | 01.04.2026 | 2.766.000 | 0,07 |
| 5.000.000 | Severstal OAO Via Steel Capital SA* | 5,90 % | 17.10.2022 | 500.000 | 0,01 |
| 4.507.000 | SF Holding Investment 2021 Ltd* | 2,38 % | 17.11.2026 | 4.189.067 | 0,11 |
| 5.100.000 | Shinhan Bank Co Ltd** | 3,88 % | 24.03.2026 | 4.930.448 | 0,12 |
| 6.581.000 | Shinhan Financial Group Co Ltd* | 1,35 % | 10.01.2026 | 6.122.225 | 0,15 |
| 2.000.000 | SierraCol Energy Andina LLC** | 6,00 % | 15.06.2028 | 1.684.880 | 0,04 |
| 4.400.000 | Sinopec Group Overseas Development 2014 Ltd** | 4,38 % | 10.04.2024 | 4.391.567 | 0,11 |
| 5.000.000 | Sinopec Group Overseas Development 2015 Ltd* | 3,25 % | 28.04.2025 | 4.890.809 | 0,12 |
| 21.866.000 | Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd** | 1,45 % | 08.01.2026 | 20.486.227 | 0,52 |
| 23.800.000 | Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd* | 2,15 % | 13.05.2025 | 22.879.446 | 0,58 |
| 27.104.000 | Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd* | 2,50 % | 08.08.2024 | 26.651.092 | 0,67 |
| 7.000.000 | Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd* | 2,50 % | 12.11.2024 | 6.850.130 | 0,17 |
| 6.078.000 | SK Hynix Inc* | 6,25 % | 17.01.2026 | 6.145.040 | 0,16 |
| 5.594.000 | SK Hynix Inc* | 6,38 % | 17.01.2028 | 5.781.881 | 0,15 |
| 1.500.000 | SK On Co Ltd** | 5,38 % | 11.05.2026 | 1.510.373 | 0,04 |
| 19.418.000 | SNB Funding Ltd* | 2,75 % | 02.10.2024 | 18.968.240 | 0,48 |
| 17.918.000 | SNB Sukuk Ltd* | 2,34 % | 19.01.2027 | 16.583.897 | 0,42 |
| 49.000.000 | Southern Gas Corridor CJSC* | 6,88 % | 24.03.2026 | 49.847.700 | 1,26 |
| 7.600.000 | Standard Chartered Plc* | 6,19 % | 06.07.2027 | 7.731.924 | 0,20 |
| 10.717.000 | State Agency of Roads of Ukraine* | 6,25 % | 24.06.2030 | 2.762.307 | 0,07 |
| 6.725.000 | Stillwater Mining Co* | 4,00 % | 16.11.2026 | 5.997.859 | 0,15 |
| 5.715.000 | Studio City Finance Ltd** | 6,00 % | 15.07.2025 | 5.600.042 | 0,14 |
| 2.500.000 | Studio City Finance Ltd* | 6,50 % | 15.01.2028 | 2.322.063 | 0,06 |
| 13.062.000 | SURA Asset Management SA** | 4,88 % | 17.04.2024 | 12.982.895 | 0,33 |
| 3.000.000 | Suzano Austria GmbH* | 2,50 % | 15.09.2028 | 2.636.542 | 0,07 |
| 2.000.000 | Tencent Holdings Ltd** | 1,81 % | 26.01.2026 | 1.874.000 | 0,05 |

Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|----------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 60,85 % (31. Dezember 2022: 68,84 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 20.847.000 | Tengizchevroil Finance Co International Ltd** | 2,63 % | 15.08.2025 | 19.664.829 | 0,50 |
| 7.087.000 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV* | 4,75 % | 09.05.2027 | 6.794.660 | 0,17 |
| 3.835.000 | Transnet SOC Ltd* | 8,25 % | 06.02.2028 | 3.872.832 | 0,10 |
| 1.500.000 | Transportadora de Gas del Sur SA* | 6,75 % | 02.05.2025 | 1.436.274 | 0,04 |
| 14.200.000 | Trust Fibra Uno** | 5,25 % | 15.12.2024 | 14.057.913 | 0,36 |
| 8.235.000 | Trust Fibra Uno* | 5,25 % | 30.01.2026 | 8.067.427 | 0,20 |
| 4.521.000 | TSMC Arizona Corp* | 3,88 % | 22.04.2027 | 4.423.701 | 0,11 |
| 2.159.000 | Tullow Oil Plc* | 10,25 % | 15.05.2026 | 1.928.634 | 0,05 |
| 1.000.000 | Turk Telekomunikasyon AS* | 4,88 % | 19.06.2024 | 983.750 | 0,02 |
| 1.000.000 | Turkcell Iletisim Hizmetleri AS* | 5,80 % | 11.04.2028 | 950.959 | 0,02 |
| 7.400.000 | Turkiye Petrol Rafinerileri AS* | 4,50 % | 18.10.2024 | 7.288.186 | 0,18 |
| 4.145.000 | Turkiye Sinai Kalkinma Bankasi AS* | 6,00 % | 23.01.2025 | 4.137.622 | 0,10 |
| 9.530.000 | Turkiye Sise ve Cam Fabrikalari AS* | 6,95 % | 14.03.2026 | 9.512.084 | 0,24 |
| 11.723.000 | Turkiye Vakiflar Bankasi TAO* | 5,50 % | 01.10.2026 | 11.253.201 | 0,28 |
| 9.678.000 | Turkiye Vakiflar Bankasi TAO* | 6,50 % | 08.01.2026 | 9.614.561 | 0,24 |
| 9.908.000 | Turkiye Vakiflar Bankasi TAO* | 9,00 % | 12.10.2028 | 10.414.695 | 0,26 |
| 1.000.000 | Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd* | 3,98 % | 09.11.2027 | 669.822 | 0,02 |
| 1.104.000 | Vedanta Resources Finance II Plc* | 8,95 % | 11.03.2025 | 821.972 | 0,02 |
| 11.096.000 | Vedanta Resources Finance II Plc* | 13,88 % | 21.01.2024 | 9.806.429 | 0,25 |
| 2.239.000 | Weibo Corp* | 3,50 % | 05.07.2024 | 2.215.233 | 0,06 |
| 4.638.000 | Wynn Macau Ltd* | 4,88 % | 01.10.2024 | 4.582.535 | 0,12 |
| 2.000.000 | Wynn Macau Ltd* | 5,50 % | 15.01.2026 | 1.953.759 | 0,05 |
| 2.500.000 | Wynn Macau Ltd* | 5,50 % | 01.10.2027 | 2.363.793 | 0,06 |
| 7.889.000 | Xingsheng BVI Co Ltd* | 1,38 % | 25.08.2024 | 7.675.839 | 0,19 |
| 14.418.000 | XP Inc** | 3,25 % | 01.07.2026 | 13.529.367 | 0,34 |
| 10.201.000 | Yapi ve Kredi Bankasi AS** | 9,25 % | 16.10.2028 | 10.831.473 | 0,27 |
| 1.572.375 | YPF SA** | 8,50 % | 23.03.2025 | 1.532.319 | 0,04 |
| 6.494.000 | Yunda Holding Investment Ltd* | 2,25 % | 19.08.2025 | 5.942.750 | 0,15 |
| 11.868.000 | Zhejiang Seaport International Co Ltd* | 1,98 % | 17.03.2026 | 11.098.123 | 0,28 |
| US-Dollar insgesamt | | | | 2.396.291.848 | 60,59 |
| Unternehmensanleihen insgesamt | | | | 2.406.487.373 | 60,85 |
| Staatsanleihen 33,07 % (31. Dezember 2022: 23,53 %) | | | | | |
| Euro | | | | | |
| 3.000.000 | Colombia Government International Bond* | 3,88 % | 22.03.2026 | 3.279.753 | 0,08 |
| 10.940.000 | Egypt Government International Bond* | 4,75 % | 11.04.2025 | 11.039.251 | 0,28 |
| 41.167.000 | Egypt Government International Bond* | 4,75 % | 16.04.2026 | 37.041.082 | 0,94 |
| 12.045.000 | Ivory Coast Government International Bond* | 5,13 % | 15.06.2025 | 13.254.266 | 0,34 |
| 35.305.000 | Ivory Coast Government International Bond* | 5,25 % | 22.03.2030 | 35.104.030 | 0,89 |
| 8.000.000 | Kazakhstan Government International Bond* | 0,60 % | 30.09.2026 | 8.255.049 | 0,21 |

Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 33,07 % (31. Dezember 2022: 23,53 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Euro (Fortsetzung) | | | | | |
| 6.053.000 | Magyar Export-Import Bank Zrt* | 6,00 % | 16.05.2029 | 7.111.652 | 0,18 |
| 30.930.000 | Romanian Government International Bond** | 2,88 % | 26.05.2028 | 32.003.722 | 0,81 |
| 28.500.000 | Romanian Government International Bond* | 5,50 % | 18.09.2028 | 32.420.987 | 0,82 |
| 24.300.000 | Romanian Government International Bond* | 6,63 % | 27.09.2029 | 28.766.134 | 0,73 |
| 18.500.000 | Senegal Government International Bond* | 4,75 % | 13.03.2028 | 18.926.211 | 0,48 |
| 42.400.000 | Serbia International Bond* | 1,00 % | 23.09.2028 | 39.651.074 | 1,00 |
| 88.646.000 | Serbia International Bond* | 3,13 % | 15.05.2027 | 93.910.122 | 2,37 |
| 6.000.000 | Ukraine Government International Bond** | 6,75 % | 20.06.2028 | 1.637.078 | 0,04 |
| Euro insgesamt | | | | 362.400.411 | 9,17 |
| US-Dollar | | | | | |
| 21.984.000 | Airport Authority* | 1,75 % | 12.01.2027 | 20.324.620 | 0,51 |
| 7.396.000 | Airport Authority* | 2,10 % | 29.12.2049 | 6.848.997 | 0,17 |
| 54.460.000 | Angolan Government International Bond* | 8,25 % | 09.05.2028 | 50.339.284 | 1,27 |
| 71.573.310 | Argentine Republic Government International Bond* | 0,75 % | 09.07.2030 | 28.880.312 | 0,73 |
| 30.845.329 | Argentine Republic Government International Bond* | 1,00 % | 09.07.2029 | 12.399.822 | 0,31 |
| 2.600.000 | Bahamas Government International Bond* | 5,75 % | 16.01.2024 | 2.582.840 | 0,07 |
| 18.190.000 | Bahamas Government International Bond* | 6,00 % | 21.11.2028 | 16.189.100 | 0,41 |
| 4.817.000 | Bank Gospodarstwa Krajowego* | 6,25 % | 31.10.2028 | 5.093.404 | 0,13 |
| 67.662.000 | Colombia Government International Bond* | 3,88 % | 25.04.2027 | 64.696.041 | 1,64 |
| 87.100.000 | Colombia Government International Bond* | 4,50 % | 15.03.2029 | 81.832.192 | 2,07 |
| 26.280.000 | Dominican Republic International Bond* | 5,50 % | 22.02.2029 | 25.754.400 | 0,65 |
| 31.050.000 | Dominican Republic International Bond* | 8,63 % | 20.04.2027 | 32.555.925 | 0,82 |
| 27.098.882 | Ecuador Government International Bond* | 6,00 % | 31.07.2030 | 12.663.548 | 0,32 |
| 20.779.000 | Egypt Government International Bond* | 5,80 % | 30.09.2027 | 16.076.297 | 0,41 |
| 11.000.000 | El Salvador Government International Bond* | 6,38 % | 18.01.2027 | 9.759.396 | 0,25 |
| 14.860.000 | El Salvador Government International Bond* | 7,65 % | 15.06.2035 | 11.646.525 | 0,29 |
| 24.616.000 | El Salvador Government International Bond* | 8,63 % | 28.02.2029 | 22.154.400 | 0,56 |
| 10.909.000 | Fondo MIVIVIENDA SA* | 4,63 % | 12.04.2027 | 10.668.527 | 0,27 |
| 18.600.000 | Ghana Government International Bond* | 6,38 % | 11.02.2027 | 8.352.330 | 0,21 |
| 25.934.000 | Ghana Government International Bond* | 10,75 % | 14.10.2030 | 16.419.490 | 0,42 |
| 6.800.000 | Guatemala Government Bond* | 5,25 % | 10.08.2029 | 6.682.700 | 0,17 |
| 8.741.000 | Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS* | 8,51 % | 14.01.2029 | 9.282.942 | 0,23 |
| 7.585.333 | Honduras Government International Bond* | 7,50 % | 15.03.2024 | 7.598.608 | 0,19 |
| 2.365.000 | Industrial Bank of Korea* | 5,38 % | 04.10.2028 | 2.443.409 | 0,06 |
| 11.435.000 | Istanbul Metropolitan Municipality* | 6,38 % | 09.12.2025 | 11.122.860 | 0,28 |
| 28.609.000 | Ivory Coast Government International Bond* | 5,38 % | 23.07.2024 | 28.374.120 | 0,72 |
| 25.591.897 | Ivory Coast Government International Bond* | 5,75 % | 31.12.2032 | 24.247.043 | 0,61 |
| 18.100.000 | Ivory Coast Government International Bond* | 6,38 % | 03.03.2028 | 17.823.613 | 0,45 |
| 9.372.000 | Korea Development Bank* | 4,38 % | 15.02.2028 | 9.331.513 | 0,24 |

Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|----------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 33,07 % (31. Dezember 2022: 23,53 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 3.600.000 | Korea Electric Power Corp [*] | 3,63 % | 14.06.2025 | 3.533.925 | 0,09 |
| 4.465.000 | Korea Electric Power Corp ^{**} | 5,38 % | 31.07.2026 | 4.515.932 | 0,11 |
| 4.325.000 | Korea Expressway Corp [*] | 1,13 % | 17.05.2026 | 3.966.405 | 0,10 |
| 800.000 | Korea Expressway Corp ^{**} | 3,63 % | 18.05.2025 | 785.420 | 0,02 |
| 25.371.000 | Korea Housing Finance Corp [*] | 4,63 % | 24.02.2028 | 25.340.143 | 0,64 |
| 4.166.000 | Korea Hydro & Nuclear Power Co Ltd [*] | 5,00 % | 18.07.2028 | 4.209.889 | 0,11 |
| 12.847.000 | Korea Land & Housing Corp [*] | 5,75 % | 06.10.2025 | 12.999.108 | 0,33 |
| 34.802.000 | Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp [*] | 1,75 % | 15.04.2026 | 32.158.881 | 0,81 |
| 37.754.000 | Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp [*] | 5,38 % | 11.05.2028 | 38.168.728 | 0,97 |
| 29.086.000 | Korea National Oil Corp [*] | 1,75 % | 18.04.2025 | 27.897.280 | 0,71 |
| 5.208.000 | Magyar Export-Import Bank Zrt ^{**} | 6,13 % | 04.12.2027 | 5.306.744 | 0,13 |
| 14.831.000 | MFB Magyar Fejlesztési Bank Zrt [*] | 6,50 % | 29.06.2028 | 15.295.952 | 0,39 |
| 12.000.000 | Mongolia Government International Bond [*] | 5,13 % | 07.04.2026 | 11.668.896 | 0,30 |
| 7.135.000 | Mongolia Government International Bond [*] | 7,88 % | 05.06.2029 | 7.306.181 | 0,19 |
| 4.281.000 | Mongolia Government International Bond [*] | 8,65 % | 19.01.2028 | 4.492.084 | 0,11 |
| 8.400.000 | Panama Government International Bond [*] | 9,38 % | 01.04.2029 | 9.588.180 | 0,24 |
| 2.552.027 | Provincia de Cordoba [*] | 6,88 % | 10.12.2025 | 2.322.822 | 0,06 |
| 5.923.077 | Provincia de Mendoza Argentina [*] | 5,75 % | 19.03.2029 | 5.079.038 | 0,13 |
| 11.651.000 | Qatar Government International Bond [*] | 3,38 % | 14.03.2024 | 11.600.621 | 0,29 |
| 2.000.000 | Republic of Azerbaijan International Bond [*] | 5,13 % | 01.09.2029 | 1.968.661 | 0,05 |
| 11.400.000 | Republic of South Africa Government International Bond [*] | 4,30 % | 12.10.2028 | 10.688.184 | 0,27 |
| 36.381.000 | Sri Lanka Government International Bond [*] | 5,75 % | 18.04.2023 | 18.713.477 | 0,47 |
| 18.000.000 | Sri Lanka Government International Bond [*] | 5,88 % | 25.07.2024 | 9.531.000 | 0,24 |
| 21.600.000 | Sri Lanka Government International Bond [*] | 6,35 % | 28.06.2024 | 11.000.978 | 0,28 |
| 27.037.000 | Sri Lanka Government International Bond [*] | 6,85 % | 14.03.2024 | 13.767.931 | 0,35 |
| 11.086.000 | Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS [*] | 9,00 % | 28.01.2027 | 11.558.729 | 0,29 |
| 13.000.000 | Ukraine Government International Bond [*] | 7,75 % | 01.09.2025 | 3.901.950 | 0,10 |
| 28.000.000 | Ukraine Government International Bond [*] | 7,75 % | 01.09.2026 | 7.864.080 | 0,20 |
| 14.819.000 | Ukraine Government International Bond [*] | 7,75 % | 01.09.2027 | 4.099.232 | 0,10 |
| 4.975.000 | Ukraine Government International Bond [*] | 7,75 % | 01.09.2028 | 1.392.592 | 0,04 |
| 2.059.000 | Ukraine Government International Bond [*] | 7,75 % | 01.09.2029 | 570.975 | 0,01 |
| 19.500.000 | Ukraine Government International Bond [*] | 8,99 % | 01.02.2026 | 5.854.504 | 0,15 |
| 44.000.000 | United States Treasury Note/Bond [*] | 4,88 % | 31.10.2028 | 45.938.750 | 1,16 |
| US-Dollar insgesamt | | | | 945.231.530 | 23,90 |
| Staatsanleihen insgesamt | | | | 1.307.631.941 | 33,07 |

Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|---|--|----------------------|------------------------------|
| Investmentfonds 1,26 % (31. Dezember 2022: 1,37 %) | | | |
| US-Dollar | | | |
| 425.000 | Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund | 49.810.000 | 1,26 |
| Investmentfonds insgesamt ^h | | 49.810.000 | 1,26 |
| Anlagen insgesamt | | 3.817.824.018 | 96,54 |

Devisenterminkontrakte 1,63 % (31. Dezember 2022: 0,91 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeits- datum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|------------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| 2.836.841 € | 3.096.767 US\$ | 03.01.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | 36.950 | 0,00 |
| 362.543.621 US\$ | 327.678.853 € | 02.02.2024 | Citibank NA | 1 | 106.705 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> | | | | | | |
| 16.296 AUD | 10.969 US\$ | 14.03.2024 | UBS AG | 1 | 175 | 0,00 |
| 1.580.561 AUD | 1.043.454 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 4 | 37.390 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen CAD</i> | | | | | | |
| 9.019 CAD | 6.701 US\$ | 14.03.2024 | Royal Bank of Canada | 2 | 146 | 0,00 |
| 412.652 CAD | 304.437 US\$ | 14.03.2024 | UBS AG | 1 | 8.820 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> | | | | | | |
| 52.107.122 CHF | 60.188.514 US\$ | 14.03.2024 | UBS AG | 2 | 2.179.000 | 0,05 |
| 1.240.926 CHF | 1.442.941 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 12 | 42.334 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 1.513.836.232 € | 1.641.250.975 US\$ | 14.03.2024 | Goldman Sachs International | 2 | 35.826.994 | 0,91 |
| 36.851.057 € | 40.403.156 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 9 | 421.668 | 0,01 |
| 319 US\$ | 286 € | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | 2 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 1.659.477 £ | 2.110.860 US\$ | 14.03.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 5.404 | 0,00 |
| 163.847.220 £ | 206.632.153 US\$ | 14.03.2024 | UBS AG | 2 | 2.315.605 | 0,06 |
| 2.790.507 £ | 3.517.275 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 8 | 41.346 | 0,00 |
| 118.401 US\$ | 92.738 £ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | 137 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen JPY</i> | | | | | | |
| 934.431.663 ¥ | 6.681.324 US\$ | 14.03.2024 | Goldman Sachs International | 2 | 21.128 | 0,00 |
| 67.882.901.314 ¥ | 468.439.553 US\$ | 14.03.2024 | Royal Bank of Canada | 1 | 18.468.033 | 0,47 |
| 15.983.234.491 ¥ | 110.337.182 US\$ | 14.03.2024 | UBS AG | 1 | 4.306.683 | 0,11 |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i> | | | | | | |
| 109.907 SEK | 10.762 US\$ | 14.03.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 175 | 0,00 |
| 10.977.514 SEK | 1.051.317 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 5 | 41.035 | 0,00 |
| 13.562 US\$ | 134.116 SEK | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | 217 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i> | | | | | | |
| 59.708.958 SGD | 44.733.394 US\$ | 14.03.2024 | Goldman Sachs International | 4 | 681.222 | 0,02 |
| 1.455.817 SGD | 1.096.418 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 14 | 10.877 | 0,00 |
| 109 US\$ | 143 SGD | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 0 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ^o | | | | | 64.552.046 | 1,63 |

Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|----------------------|------------------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 3.882.376.064 | 98,17 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,23 %) (31. Dezember 2022: (0,47 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettövermögens |
|--|---------------------|------------------|----------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 327.678.853 € | 362.117.900 US\$ | 03.01.2024 | Citibank NA | 1 | (147.411) | (0,00) |
| 361.721.300 US\$ | 330.515.694 € | 03.01.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | (3.382.906) | (0,09) |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> | | | | | | |
| 69 US\$ | 104 AUD | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (2) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> | | | | | | |
| 20 CHF | 24 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (0) | (0,00) |
| 1.278.815 US\$ | 1.108.907 CHF | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 12 | (48.447) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 557.934 € | 621.511 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | (3.413) | (0,00) |
| 222.684.679 US\$ | 205.478.903 € | 14.03.2024 | UBS AG | 1 | (4.951.663) | (0,12) |
| 33.545.582 US\$ | 30.519.106 € | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 18 | (264.497) | (0,01) |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 406.649 £ | 519.069 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 5 | (485) | (0,00) |
| 5.574.630 US\$ | 4.420.535 £ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 15 | (62.701) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen JPY</i> | | | | | | |
| 910.000 ¥ | 6.530 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (3) | (0,00) |
| 15.742.601 US\$ | 2.232.166.170 ¥ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 4 | (268.185) | (0,01) |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i> | | | | | | |
| 1.008 SEK | 102 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (1) | (0,00) |
| 33.296 US\$ | 342.704 SEK | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 6 | (805) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i> | | | | | | |
| 36.337 SGD | 27.656 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | (19) | (0,00) |
| 67.547 US\$ | 90.299 SGD | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 13 | (1.137) | (0,00) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | (9.131.675) | (0,23) |

| | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|---|----------------------|------------------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (9.131.675) | (0,23) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | 3.873.244.389 | 97,94 |
| Sonstiges Nettovermögen | 81.525.178 | 2,06 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | 3.954.769.567 | 100,00 |

Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

| Portfolioanalyse | US\$ | % des Gesamtver- mögens |
|---|----------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 3.059.546.367 | 77,06 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 708.467.651 | 17,84 |
| μ Investmentfonds | 49.810.000 | 1,25 |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente | 55.420.371 | 1,40 |
| Anlagen insgesamt | 3.873.244.389 | 97,55 |

Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 89,20 % (31. Dezember 2022: 85,85 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 2.625.000 | 1011778 BC ULC/New Red Finance Inc** | 3,88 % | 15.01.2028 | 2.481.802 | 0,33 |
| 4.010.000 | 1011778 BC ULC/New Red Finance Inc** | 4,38 % | 15.01.2028 | 3.833.520 | 0,51 |
| 725.000 | Acadia Healthcare Co Inc** | 5,50 % | 01.07.2028 | 714.867 | 0,10 |
| 3.400.000 | Adient Global Holdings Ltd** | 4,88 % | 15.08.2026 | 3.326.858 | 0,45 |
| 690.000 | Adient Global Holdings Ltd** | 7,00 % | 15.04.2028 | 713.641 | 0,10 |
| 5.700.000 | Advanced Drainage Systems Inc** | 5,00 % | 30.09.2027 | 5.506.115 | 0,74 |
| 600.000 | AerCap Global Aviation Trust* | 6,50 % | 15.06.2045 | 601.614 | 0,08 |
| 900.000 | AerCap Holdings NV* | 5,88 % | 10.10.2079 | 889.666 | 0,12 |
| 1.515.000 | Ahlstrom Holding 3 Oy* | 4,88 % | 04.02.2028 | 1.330.176 | 0,18 |
| 1.725.000 | Air Canada** | 3,88 % | 15.08.2026 | 1.649.134 | 0,22 |
| 790.000 | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC** | 3,25 % | 15.03.2026 | 745.863 | 0,10 |
| 530.000 | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC** | 4,63 % | 15.01.2027 | 515.599 | 0,07 |
| 1.235.000 | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC** | 5,88 % | 15.02.2028 | 1.236.601 | 0,17 |
| 4.390.000 | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC** | 6,50 % | 15.02.2028 | 4.445.195 | 0,60 |
| 685.000 | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC** | 7,50 % | 15.03.2026 | 698.154 | 0,09 |
| 2.890.000 | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer** | 4,25 % | 15.10.2027 | 2.779.963 | 0,37 |
| 4.400.000 | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer** | 6,75 % | 15.10.2027 | 4.389.000 | 0,59 |
| 1.735.000 | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer** | 6,75 % | 15.04.2028 | 1.776.041 | 0,24 |
| 1.185.000 | Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp** | 6,63 % | 15.07.2026 | 1.179.891 | 0,16 |
| 360.000 | Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp** | 9,75 % | 15.07.2027 | 353.166 | 0,05 |
| 790.000 | Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl** | 4,63 % | 01.06.2028 | 719.087 | 0,10 |
| 410.000 | Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl 144A** | 4,63 % | 01.06.2028 | 375.146 | 0,05 |
| 5.580.000 | Ally Financial Inc* | 5,75 % | 20.11.2025 | 5.549.495 | 0,75 |
| 3.940.000 | Altice Financing SA** | 5,00 % | 15.01.2028 | 3.574.610 | 0,48 |
| 1.330.000 | Altice France SA* | 5,50 % | 15.01.2028 | 1.096.406 | 0,15 |
| 3.825.000 | Altice France SA** | 8,13 % | 01.02.2027 | 3.529.119 | 0,47 |
| 6.045.000 | American Airlines Inc** | 7,25 % | 15.02.2028 | 6.119.626 | 0,82 |
| 2.458.334 | American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd** | 5,50 % | 20.04.2026 | 2.442.407 | 0,33 |
| 5.315.000 | Amsted Industries Inc** | 5,63 % | 01.07.2027 | 5.301.250 | 0,71 |
| 5.745.000 | APX Group Inc** | 6,75 % | 15.02.2027 | 5.738.738 | 0,77 |
| 1.895.000 | Aramark Services Inc** | 5,00 % | 01.02.2028 | 1.839.495 | 0,25 |
| 750.000 | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc** | 3,25 % | 01.09.2028 | 656.984 | 0,09 |
| 3.155.000 | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc** | 6,00 % | 15.06.2027 | 3.145.669 | 0,42 |
| 1.970.000 | Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc** | 5,25 % | 15.08.2027 | 1.532.738 | 0,21 |
| 4.620.000 | Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp** | 7,00 % | 01.11.2026 | 4.656.239 | 0,63 |
| 2.130.000 | Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp** | 8,25 % | 31.12.2028 | 2.144.870 | 0,29 |
| 5.315.000 | ASGN Inc** | 4,63 % | 15.05.2028 | 5.052.583 | 0,68 |
| 4.525.000 | AssuredPartners Inc** | 7,00 % | 15.08.2025 | 4.537.480 | 0,61 |
| 1.255.000 | ATI Inc* | 5,88 % | 01.12.2027 | 1.238.263 | 0,17 |

Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 89,20 % (31. Dezember 2022: 85,85 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 395.000 | ATS Corp** | 4,13 % | 15.12.2028 | 363.570 | 0,05 |
| 1.190.000 | Avantor Funding Inc** | 4,63 % | 15.07.2028 | 1.150.981 | 0,15 |
| 5.405.000 | Avient Corp** | 5,75 % | 15.05.2025 | 5.410.616 | 0,73 |
| 1.165.000 | Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance Inc** | 4,75 % | 01.04.2028 | 1.073.690 | 0,14 |
| 775.000 | Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance Inc** | 5,38 % | 01.03.2029 | 717.769 | 0,10 |
| 1.455.000 | Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance Inc** | 5,75 % | 15.07.2027 | 1.412.259 | 0,19 |
| 1.130.000 | Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance Inc 144A** | 5,75 % | 15.07.2027 | 1.084.125 | 0,15 |
| 1.760.000 | Avolon Holdings Funding Ltd** | 6,38 % | 04.05.2028 | 1.796.152 | 0,24 |
| 400.000 | Axalta Coating Systems LLC** | 3,38 % | 15.02.2029 | 359.368 | 0,05 |
| 3.740.000 | Axalta Coating Systems LLC/Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV** | 4,75 % | 15.06.2027 | 3.638.039 | 0,49 |
| 1.310.000 | Bank of America Corp** | 6,13 % | 29.12.2049 | 1.316.419 | 0,18 |
| 3.675.000 | Bath & Body Works Inc* | 5,25 % | 01.02.2028 | 3.638.253 | 0,49 |
| 1.155.000 | Bausch & Lomb Escrow Corp** | 8,38 % | 01.10.2028 | 1.219.899 | 0,16 |
| 585.000 | Bausch Health Cos Inc** | 4,88 % | 01.06.2028 | 353.026 | 0,05 |
| 4.140.000 | Bausch Health Cos Inc** | 5,50 % | 01.11.2025 | 3.790.977 | 0,51 |
| 655.000 | Bausch Health Cos Inc** | 6,13 % | 01.02.2027 | 442.819 | 0,06 |
| 3.860.000 | BCPE Empire Holdings Inc** | 7,63 % | 01.05.2027 | 3.726.062 | 0,50 |
| 490.000 | Beacon Roofing Supply Inc** | 4,50 % | 15.11.2026 | 477.842 | 0,06 |
| 4.775.000 | Benteler International AG** | 10,50 % | 15.05.2028 | 5.033.924 | 0,68 |
| 2.965.000 | Berry Global Inc** | 5,63 % | 15.07.2027 | 2.945.863 | 0,40 |
| 1.320.000 | Blackstone Mortgage Trust Inc** | 3,75 % | 15.01.2027 | 1.175.232 | 0,16 |
| 2.640.000 | Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp** | 6,63 % | 15.07.2026 | 2.626.523 | 0,35 |
| 4.345.000 | Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp** | 7,63 % | 15.12.2025 | 4.406.060 | 0,59 |
| 1.835.000 | Bombardier Inc** | 6,00 % | 15.02.2028 | 1.790.007 | 0,24 |
| 1.390.000 | Borr IHC Ltd/Borr Finance LLC** | 10,00 % | 15.11.2028 | 1.452.550 | 0,19 |
| 5.265.000 | Buckeye Partners LP** | 4,13 % | 01.12.2027 | 4.995.508 | 0,67 |
| 735.000 | Buckeye Partners LP** | 4,50 % | 01.03.2028 | 693.137 | 0,09 |
| 860.000 | Cablevision Lightpath LLC** | 3,88 % | 15.09.2027 | 756.052 | 0,10 |
| 1.995.000 | Calderys Financing LLC** | 11,25 % | 01.06.2028 | 2.092.038 | 0,28 |
| 7.110.000 | Camelot Return Merger Sub Inc** | 8,75 % | 01.08.2028 | 7.226.065 | 0,97 |
| 1.490.000 | Catalent Pharma Solutions Inc** | 5,00 % | 15.07.2027 | 1.441.124 | 0,19 |
| 3.900.000 | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp** | 5,00 % | 01.02.2028 | 3.734.494 | 0,50 |
| 6.715.000 | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp** | 5,13 % | 01.05.2027 | 6.492.026 | 0,87 |
| 1.990.000 | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp** | 5,50 % | 01.05.2026 | 1.977.991 | 0,27 |
| 5.295.000 | Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op** | 6,50 % | 01.10.2028 | 5.262.791 | 0,71 |
| 1.020.000 | Chesapeake Energy Corp** | 5,50 % | 01.02.2026 | 1.012.084 | 0,14 |
| 1.135.000 | CHS/Community Health Systems Inc** | 5,63 % | 15.03.2027 | 1.056.053 | 0,14 |

Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---------------------------------------|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 89,20 % (31. Dezember 2022: 85,85 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 1.376.000 | CHS/Community Health Systems Inc** | 8,00 % | 15.03.2026 | 1.372.653 | 0,18 |
| 735.000 | Civitas Resources Inc** | 5,00 % | 15.10.2026 | 713.507 | 0,10 |
| 6.580.000 | Civitas Resources Inc** | 8,38 % | 01.07.2028 | 6.877.383 | 0,92 |
| 2.025.000 | CommScope Inc** | 6,00 % | 01.03.2026 | 1.806.705 | 0,24 |
| 1.750.000 | CommScope Inc** | 8,25 % | 01.03.2027 | 925.593 | 0,12 |
| 440.000 | CommScope Technologies LLC** | 5,00 % | 15.03.2027 | 183.561 | 0,02 |
| 1.565.000 | Consensus Cloud Solutions Inc** | 6,00 % | 15.10.2026 | 1.489.583 | 0,20 |
| 1.885.000 | Coty Inc** | 5,00 % | 15.04.2026 | 1.856.399 | 0,25 |
| 4.885.000 | CSC Holdings LLC** | 5,25 % | 01.06.2024 | 4.785.547 | 0,64 |
| 4.835.000 | CSC Holdings LLC** | 5,50 % | 15.04.2027 | 4.472.216 | 0,60 |
| 1.865.000 | CSC Holdings LLC** | 11,25 % | 15.05.2028 | 1.922.936 | 0,26 |
| 4.560.000 | Cushman & Wakefield US Borrower LLC** | 6,75 % | 15.05.2028 | 4.541.828 | 0,61 |
| 3.390.000 | Dana Inc* | 5,38 % | 15.11.2027 | 3.369.660 | 0,45 |
| 2.090.000 | Dana Inc* | 5,63 % | 15.06.2028 | 2.062.473 | 0,28 |
| 555.000 | Dealer Tire LLC/DT Issuer LLC** | 8,00 % | 01.02.2028 | 550.097 | 0,07 |
| 3.530.000 | DISH DBS Corp** | 5,25 % | 01.12.2026 | 3.030.946 | 0,41 |
| 1.160.000 | DISH DBS Corp** | 7,75 % | 01.07.2026 | 809.146 | 0,11 |
| 2.135.000 | DISH Network Corp** | 3,38 % | 15.08.2026 | 1.142.225 | 0,15 |
| 1.740.000 | DISH Network Corp** | 11,75 % | 15.11.2027 | 1.817.729 | 0,24 |
| 1.735.000 | Edgewell Personal Care Co** | 5,50 % | 01.06.2028 | 1.704.377 | 0,23 |
| 1.120.000 | Encompass Health Corp* | 4,50 % | 01.02.2028 | 1.072.623 | 0,14 |
| 720.000 | Encompass Health Corp* | 5,75 % | 15.09.2025 | 717.788 | 0,10 |
| 2.010.000 | Energizer Holdings Inc** | 4,75 % | 15.06.2028 | 1.860.431 | 0,25 |
| 4.820.000 | Energizer Holdings Inc** | 6,50 % | 31.12.2027 | 4.824.969 | 0,65 |
| 3.480.000 | Energy Transfer LP** | 5,63 % | 01.05.2027 | 3.470.431 | 0,47 |
| 385.000 | Energy Transfer LP* | 5,75 % | 01.04.2025 | 385.395 | 0,05 |
| 5.830.000 | EnerSys** | 4,38 % | 15.12.2027 | 5.542.144 | 0,74 |
| 2.125.000 | Enviri Corp** | 5,75 % | 31.07.2027 | 1.982.997 | 0,27 |
| 755.000 | EQM Midstream Partners LP** | 4,50 % | 15.01.2029 | 713.955 | 0,10 |
| 1.495.000 | EQM Midstream Partners LP** | 6,00 % | 01.07.2025 | 1.495.248 | 0,20 |
| 800.000 | EQM Midstream Partners LP** | 7,50 % | 01.06.2027 | 824.818 | 0,11 |
| 4.980.000 | EquipmentShare.com Inc** | 9,00 % | 15.05.2028 | 5.129.898 | 0,69 |
| 2.142.000 | First Quantum Minerals Ltd** | 7,50 % | 01.04.2025 | 2.044.336 | 0,27 |
| 660.000 | Ford Motor Credit Co LLC* | 2,70 % | 10.08.2026 | 611.578 | 0,08 |
| 1.115.000 | Ford Motor Credit Co LLC* | 2,90 % | 16.02.2028 | 1.001.967 | 0,13 |
| 2.440.000 | Ford Motor Credit Co LLC* | 3,38 % | 13.11.2025 | 2.336.015 | 0,31 |
| 770.000 | Ford Motor Credit Co LLC* | 4,39 % | 08.01.2026 | 749.226 | 0,10 |
| 995.000 | Ford Motor Credit Co LLC* | 4,95 % | 28.05.2027 | 971.472 | 0,13 |

Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 89,20 % (31. Dezember 2022: 85,85 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 1.125.000 | Ford Motor Credit Co LLC* | 6,95 % | 10.06.2026 | 1.154.758 | 0,15 |
| 2.105.000 | Ford Motor Credit Co LLC* | 7,35 % | 04.11.2027 | 2.221.266 | 0,30 |
| 1.890.000 | Frontier Communications Holdings LLC** | 5,00 % | 01.05.2028 | 1.748.433 | 0,23 |
| 4.680.000 | Frontier Communications Holdings LLC** | 5,88 % | 15.10.2027 | 4.525.238 | 0,61 |
| 1.100.000 | Gates Global LLC/Gates Corp** | 6,25 % | 15.01.2026 | 1.095.699 | 0,15 |
| 5.135.000 | Gen Digital Inc** | 6,75 % | 30.09.2027 | 5.227.194 | 0,70 |
| 3.760.000 | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp* | 8,00 % | 15.01.2027 | 3.825.067 | 0,51 |
| 1.320.000 | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp* | 8,25 % | 15.01.2029 | 1.359.389 | 0,18 |
| 2.869.170 | Global Aircraft Leasing Co Ltd** | 6,50 % | 15.09.2024 | 2.700.362 | 0,36 |
| 2.385.000 | Go Daddy Operating Co LLC/GD Finance Co Inc** | 5,25 % | 01.12.2027 | 2.339.263 | 0,31 |
| 1.425.000 | Goodyear Tire & Rubber Co** | 4,88 % | 15.03.2027 | 1.380.658 | 0,19 |
| 2.690.000 | Goodyear Tire & Rubber Co** | 9,50 % | 31.05.2025 | 2.731.278 | 0,37 |
| 3.635.000 | GTCR AP Finance Inc** | 8,00 % | 15.05.2027 | 3.676.832 | 0,49 |
| 5.145.000 | Hertz Corp** | 4,63 % | 01.12.2026 | 4.617.455 | 0,62 |
| 3.360.000 | Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co** | 6,25 % | 01.11.2028 | 3.350.785 | 0,45 |
| 3.245.000 | Howard Midstream Energy Partners LLC** | 6,75 % | 15.01.2027 | 3.212.137 | 0,43 |
| 2.685.000 | Howard Midstream Energy Partners LLC** | 8,88 % | 15.07.2028 | 2.820.993 | 0,38 |
| 1.505.000 | Hudbay Minerals Inc** | 4,50 % | 01.04.2026 | 1.459.318 | 0,20 |
| 1.155.000 | IHO Verwaltungs GmbH** | 4,75 % | 15.09.2026 | 1.107.605 | 0,15 |
| 730.000 | IHO Verwaltungs GmbH* | 6,00 % | 15.05.2027 | 712.041 | 0,10 |
| 3.735.000 | Iliad Holding SASU** | 6,50 % | 15.10.2026 | 3.730.363 | 0,50 |
| 1.810.000 | Iliad Holding SASU** | 7,00 % | 15.10.2028 | 1.802.423 | 0,24 |
| 510.000 | Illuminate Buyer LLC/Illuminate Holdings IV Inc** | 9,00 % | 01.07.2028 | 488.274 | 0,07 |
| 2.345.000 | INEOS Finance Plc* | 6,75 % | 15.05.2028 | 2.305.667 | 0,31 |
| 900.000 | INEOS Quattro Finance 2 Plc** | 9,63 % | 15.03.2029 | 959.140 | 0,13 |
| 1.845.000 | IQVIA Inc** | 5,00 % | 15.05.2027 | 1.811.919 | 0,24 |
| 3.055.000 | Iron Mountain Inc** | 4,88 % | 15.09.2027 | 2.983.011 | 0,40 |
| 1.785.000 | Iron Mountain Inc** | 5,25 % | 15.03.2028 | 1.736.577 | 0,23 |
| 2.373.000 | JELD-WEN Inc** | 4,63 % | 15.12.2025 | 2.298.322 | 0,31 |
| 3.990.000 | JELD-WEN Inc** | 4,88 % | 15.12.2027 | 3.774.740 | 0,51 |
| 2.905.000 | JPMorgan Chase & Co** | 4,60 % | 29.12.2049 | 2.808.612 | 0,38 |
| 3.200.000 | KB Home* | 6,88 % | 15.06.2027 | 3.330.204 | 0,45 |
| 1.905.000 | Kinetik Holdings LP** | 6,63 % | 15.12.2028 | 1.942.026 | 0,26 |
| 760.000 | Kohl's Corp* | 4,25 % | 17.07.2025 | 742.355 | 0,10 |
| 2.775.000 | Legacy LifePoint Health LLC** | 4,38 % | 15.02.2027 | 2.564.985 | 0,34 |
| 1.145.000 | Level 3 Financing Inc** | 3,40 % | 01.03.2027 | 1.094.519 | 0,15 |
| 1.570.000 | Level 3 Financing Inc** | 4,25 % | 01.07.2028 | 871.873 | 0,12 |
| 1.490.000 | Level 3 Financing Inc** | 4,63 % | 15.09.2027 | 900.513 | 0,12 |

Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 89,20 % (31. Dezember 2022: 85,85 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 1.905.000 | Level 3 Financing Inc** | 10,50 % | 15.05.2030 | 1.819.987 | 0,24 |
| 1.105.000 | Lindblad Expeditions Holdings Inc** | 9,00 % | 15.05.2028 | 1.147.504 | 0,15 |
| 2.805.000 | Lindblad Expeditions LLC** | 6,75 % | 15.02.2027 | 2.793.359 | 0,37 |
| 720.000 | Live Nation Entertainment Inc** | 3,75 % | 15.01.2028 | 673.267 | 0,09 |
| 3.200.000 | Live Nation Entertainment Inc** | 4,75 % | 15.10.2027 | 3.071.040 | 0,41 |
| 1.955.000 | Live Nation Entertainment Inc** | 5,63 % | 15.03.2026 | 1.938.901 | 0,26 |
| 790.000 | LPL Holdings Inc** | 4,00 % | 15.03.2029 | 731.980 | 0,10 |
| 945.000 | LPL Holdings Inc** | 4,63 % | 15.11.2027 | 913.572 | 0,12 |
| 1.230.000 | Lumen Technologies Inc** | 4,00 % | 15.02.2027 | 794.961 | 0,11 |
| 2.425.000 | Madison IAQ LLC** | 4,13 % | 30.06.2028 | 2.207.090 | 0,30 |
| 5.155.000 | Manitowoc Co Inc** | 9,00 % | 01.04.2026 | 5.193.299 | 0,70 |
| 4.330.000 | Masonite International Corp** | 5,38 % | 01.02.2028 | 4.162.689 | 0,56 |
| 6.165.000 | Mattamy Group Corp** | 5,25 % | 15.12.2027 | 6.000.856 | 0,81 |
| 5.415.000 | Mauser Packaging Solutions Holding Co** | 7,88 % | 15.08.2026 | 5.515.616 | 0,74 |
| 1.105.000 | Mauser Packaging Solutions Holding Co** | 9,25 % | 15.04.2027 | 1.085.817 | 0,15 |
| 2.805.000 | McGraw-Hill Education Inc** | 5,75 % | 01.08.2028 | 2.707.582 | 0,36 |
| 2.325.000 | Meritage Homes Corp* | 5,13 % | 06.06.2027 | 2.293.571 | 0,31 |
| 1.165.000 | Midcontinent Communications/Midcontinent Finance Corp** | 5,38 % | 15.08.2027 | 1.136.568 | 0,15 |
| 3.325.000 | Molina Healthcare Inc** | 4,38 % | 15.06.2028 | 3.147.957 | 0,42 |
| 920.000 | MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp* | 5,00 % | 15.10.2027 | 752.323 | 0,10 |
| 3.050.000 | MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp* | 5,25 % | 01.08.2026 | 2.730.003 | 0,37 |
| 1.090.000 | Nabors Industries Inc** | 7,38 % | 15.05.2027 | 1.069.010 | 0,14 |
| 1.990.000 | NCL Corp Ltd** | 8,38 % | 01.02.2028 | 2.108.445 | 0,28 |
| 4.625.000 | New Fortress Energy Inc** | 6,50 % | 30.09.2026 | 4.446.049 | 0,60 |
| 2.830.000 | New Fortress Energy Inc** | 6,75 % | 15.09.2025 | 2.809.684 | 0,38 |
| 735.000 | Newell Brands Inc** | 5,20 % | 01.04.2026 | 725.372 | 0,10 |
| 745.000 | NMG Holding Co Inc/Neiman Marcus Group LLC** | 7,13 % | 01.04.2026 | 716.505 | 0,10 |
| 1.435.000 | Northern Oil & Gas Inc** | 8,13 % | 01.03.2028 | 1.454.430 | 0,20 |
| 2.905.000 | Northwest Fiber LLC/Northwest Fiber Finance Sub Inc** | 4,75 % | 30.04.2027 | 2.776.584 | 0,37 |
| 1.120.000 | NOVA Chemicals Corp** | 5,00 % | 01.05.2025 | 1.093.603 | 0,15 |
| 1.600.000 | NOVA Chemicals Corp** | 5,25 % | 01.06.2027 | 1.501.982 | 0,20 |
| 1.155.000 | Novelis Corp** | 3,25 % | 15.11.2026 | 1.088.084 | 0,15 |
| 1.300.000 | NuStar Logistics LP* | 5,75 % | 01.10.2025 | 1.292.960 | 0,17 |
| 1.190.000 | Olympus Water US Holding Corp** | 4,25 % | 01.10.2028 | 1.072.142 | 0,14 |
| 4.670.000 | Olympus Water US Holding Corp** | 7,13 % | 01.10.2027 | 4.678.850 | 0,63 |
| 1.655.000 | OneMain Finance Corp* | 3,50 % | 15.01.2027 | 1.532.793 | 0,21 |
| 900.000 | OneMain Finance Corp* | 3,88 % | 15.09.2028 | 797.008 | 0,11 |
| 925.000 | OneMain Finance Corp* | 6,63 % | 15.01.2028 | 934.531 | 0,13 |

Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 89,20 % (31. Dezember 2022: 85,85 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 745.000 | OneMain Finance Corp** | 6,88 % | 15.03.2025 | 754.748 | 0,10 |
| 3.885.000 | OneMain Finance Corp** | 7,13 % | 15.03.2026 | 3.960.618 | 0,53 |
| 2.925.000 | Open Text Corp** | 3,88 % | 15.02.2028 | 2.719.774 | 0,36 |
| 2.885.000 | Pactiv Evergreen Group Issuer Inc/Pactiv Evergreen Group Issuer LLC** | 4,00 % | 15.10.2027 | 2.699.278 | 0,36 |
| 2.825.000 | Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer** | 5,88 % | 01.10.2028 | 2.780.917 | 0,37 |
| 6.390.000 | Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer** | 7,50 % | 01.06.2025 | 6.430.190 | 0,86 |
| 2.305.000 | Performance Food Group Inc** | 5,50 % | 15.10.2027 | 2.273.660 | 0,31 |
| 4.240.000 | Performance Food Group Inc** | 6,88 % | 01.05.2025 | 4.255.137 | 0,57 |
| 865.000 | Permian Resources Operating LLC** | 5,38 % | 15.01.2026 | 854.247 | 0,11 |
| 2.300.000 | Permian Resources Operating LLC** | 7,75 % | 15.02.2026 | 2.341.929 | 0,31 |
| 4.735.000 | PetSmart Inc/PetSmart Finance Corp** | 4,75 % | 15.02.2028 | 4.467.587 | 0,60 |
| 590.000 | Presidio Holdings Inc** | 4,88 % | 01.02.2027 | 578.869 | 0,08 |
| 2.275.000 | Presidio Holdings Inc** | 8,25 % | 01.02.2028 | 2.300.712 | 0,31 |
| 1.435.000 | Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc** | 3,38 % | 31.08.2027 | 1.331.422 | 0,18 |
| 2.795.000 | Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc** | 5,75 % | 15.04.2026 | 2.811.904 | 0,38 |
| 4.650.000 | Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc** | 6,25 % | 15.01.2028 | 4.626.511 | 0,62 |
| 3.690.000 | Qwest Corp** | 7,25 % | 15.09.2025 | 3.619.798 | 0,49 |
| 1.725.000 | Regal Rexnord Corp** | 6,05 % | 15.02.2026 | 1.744.454 | 0,23 |
| 1.790.000 | RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp** | 4,75 % | 15.10.2027 | 1.730.259 | 0,23 |
| 1.190.000 | RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp** | 7,25 % | 15.07.2028 | 1.237.971 | 0,17 |
| 2.875.000 | Ritchie Bros Holdings Inc** | 6,75 % | 15.03.2028 | 2.963.614 | 0,40 |
| 6.660.000 | RLJ Lodging Trust LP** | 3,75 % | 01.07.2026 | 6.315.373 | 0,85 |
| 1.330.000 | Royal Caribbean Cruises Ltd** | 4,25 % | 01.07.2026 | 1.285.444 | 0,17 |
| 2.185.000 | Royal Caribbean Cruises Ltd** | 5,50 % | 01.04.2028 | 2.158.526 | 0,29 |
| 2.805.000 | Royal Caribbean Cruises Ltd** | 11,63 % | 15.08.2027 | 3.054.292 | 0,41 |
| 1.305.000 | SCIH Salt Holdings Inc** | 4,88 % | 01.05.2028 | 1.222.206 | 0,16 |
| 815.000 | SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC** | 5,38 % | 01.11.2026 | 783.310 | 0,10 |
| 3.700.000 | Select Medical Corp** | 6,25 % | 15.08.2026 | 3.720.883 | 0,50 |
| 5.930.000 | Sirius XM Radio Inc** | 4,00 % | 15.07.2028 | 5.488.113 | 0,74 |
| 2.115.000 | Sirius XM Radio Inc** | 5,00 % | 01.08.2027 | 2.044.398 | 0,27 |
| 2.818.000 | Six Flags Entertainment Corp** | 5,50 % | 15.04.2027 | 2.757.090 | 0,37 |
| 3.070.000 | SNF Group SACA** | 3,13 % | 15.03.2027 | 2.796.282 | 0,38 |
| 5.340.000 | Solaris Midstream Holdings LLC** | 7,63 % | 01.04.2026 | 5.418.514 | 0,73 |
| 1.960.000 | SRS Distribution Inc** | 4,63 % | 01.07.2028 | 1.861.629 | 0,25 |
| 2.890.000 | SRS Distribution Inc** | 6,00 % | 01.12.2029 | 2.698.007 | 0,36 |
| 5.935.000 | Standard Industries Inc** | 5,00 % | 15.02.2027 | 5.790.790 | 0,78 |
| 1.610.000 | Starwood Property Trust Inc** | 3,63 % | 15.07.2026 | 1.526.538 | 0,20 |
| 2.605.000 | Starwood Property Trust Inc** | 4,38 % | 15.01.2027 | 2.457.778 | 0,33 |

Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 89,20 % (31. Dezember 2022: 85,85 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 930.000 | Summer BC Bidco B LLC** | 5,50 % | 31.10.2026 | 871.973 | 0,12 |
| 735.000 | Summit Materials LLC/Summit Materials Finance Corp** | 5,25 % | 15.01.2029 | 711.800 | 0,10 |
| 3.110.000 | Sunnova Energy Corp** | 5,88 % | 01.09.2026 | 2.650.155 | 0,36 |
| 3.270.000 | Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp** | 5,50 % | 15.01.2028 | 3.093.595 | 0,42 |
| 3.090.000 | Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp** | 6,00 % | 01.03.2027 | 3.024.770 | 0,41 |
| 1.840.000 | Taylor Morrison Communities Inc** | 5,88 % | 15.06.2027 | 1.851.307 | 0,25 |
| 2.325.000 | Team Health Holdings Inc† | 13,50 % | 30.06.2028 | 2.278.500 | 0,31 |
| 720.000 | Telecom Italia SpA† | 5,30 % | 30.05.2024 | 717.238 | 0,10 |
| 1.705.000 | Tempo Acquisition LLC/Tempo Acquisition Finance Corp** | 5,75 % | 01.06.2025 | 1.709.723 | 0,23 |
| 1.530.000 | Tenet Healthcare Corp** | 4,63 % | 15.06.2028 | 1.461.056 | 0,20 |
| 1.660.000 | Tenet Healthcare Corp** | 5,13 % | 01.11.2027 | 1.623.938 | 0,22 |
| 3.115.000 | Tenet Healthcare Corp** | 6,13 % | 01.10.2028 | 3.108.926 | 0,42 |
| 5.875.000 | Tenet Healthcare Corp** | 6,25 % | 01.02.2027 | 5.907.935 | 0,79 |
| 5.680.000 | TK Elevator US Newco Inc** | 5,25 % | 15.07.2027 | 5.583.650 | 0,75 |
| 1.205.000 | TMS International Corp** | 6,25 % | 15.04.2029 | 995.758 | 0,13 |
| 1.530.000 | TransDigm Inc† | 4,63 % | 15.01.2029 | 1.437.435 | 0,19 |
| 3.835.000 | TransDigm Inc† | 5,50 % | 15.11.2027 | 3.760.457 | 0,50 |
| 2.095.000 | TransDigm Inc** | 6,25 % | 15.03.2026 | 2.093.507 | 0,28 |
| 2.330.000 | TransDigm Inc** | 6,75 % | 15.08.2028 | 2.386.694 | 0,32 |
| 6.680.000 | TransDigm Inc† | 7,50 % | 15.03.2027 | 6.718.016 | 0,90 |
| 344.000 | TreeHouse Foods Inc† | 4,00 % | 01.09.2028 | 304.939 | 0,04 |
| 1.725.000 | TRI Pointe Group Inc/TRI Pointe Homes Inc† | 5,88 % | 15.06.2024 | 1.726.975 | 0,23 |
| 2.410.000 | Tri Pointe Homes Inc† | 5,25 % | 01.06.2027 | 2.370.560 | 0,32 |
| 6.855.000 | Trivium Packaging Finance BV† | 5,50 % | 15.08.2026 | 6.732.665 | 0,90 |
| 790.000 | TTM Technologies Inc** | 4,00 % | 01.03.2029 | 718.576 | 0,10 |
| 1.750.000 | Uber Technologies Inc** | 6,25 % | 15.01.2028 | 1.755.937 | 0,24 |
| 3.035.000 | United Airlines Inc** | 4,38 % | 15.04.2026 | 2.959.703 | 0,40 |
| 2.035.000 | United Rentals North America Inc† | 4,88 % | 15.01.2028 | 1.988.215 | 0,27 |
| 715.000 | United Rentals North America Inc† | 5,50 % | 15.05.2027 | 717.076 | 0,10 |
| 2.805.000 | Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC** | 10,50 % | 15.02.2028 | 2.846.121 | 0,38 |
| 910.000 | US Acute Care Solutions LLC** | 6,38 % | 01.03.2026 | 761.397 | 0,10 |
| 750.000 | US Foods Inc** | 4,75 % | 15.02.2029 | 712.878 | 0,10 |
| 1.265.000 | US Foods Inc** | 6,88 % | 15.09.2028 | 1.303.722 | 0,17 |
| 2.810.000 | Venture Global LNG Inc** | 9,50 % | 01.02.2029 | 2.975.206 | 0,40 |
| 715.000 | Viasat Inc** | 5,63 % | 15.09.2025 | 697.850 | 0,09 |
| 1.250.000 | Viking Cruises Ltd** | 5,88 % | 15.09.2027 | 1.207.344 | 0,16 |
| 2.050.000 | Virgin Media Vendor Financing Notes IV DAC† | 5,00 % | 15.07.2028 | 1.927.409 | 0,26 |
| 2.575.000 | VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc** | 7,88 % | 01.05.2027 | 2.217.735 | 0,30 |

Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 89,20 % (31. Dezember 2022: 85,85 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 1.690.000 | VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc** | 9,50 % | 01.06.2028 | 1.432.338 | 0,19 |
| 6.300.000 | VOC Escrow Ltd** | 5,00 % | 15.02.2028 | 6.038.198 | 0,81 |
| 1.895.000 | White Cap Buyer LLC** | 6,88 % | 15.10.2028 | 1.836.751 | 0,25 |
| 2.615.000 | White Cap Parent LLC** | 8,25 % | 15.03.2026 | 2.606.274 | 0,35 |
| 3.830.000 | William Carter Co** | 5,63 % | 15.03.2027 | 3.784.518 | 0,51 |
| 2.635.000 | WR Grace Holdings LLC** | 4,88 % | 15.06.2027 | 2.538.429 | 0,34 |
| 1.880.000 | Wyndham Hotels & Resorts Inc** | 4,38 % | 15.08.2028 | 1.759.258 | 0,24 |
| 7.950.000 | XHR LP** | 6,38 % | 15.08.2025 | 7.936.922 | 1,07 |
| 1.795.000 | XPO Inc** | 6,25 % | 01.06.2028 | 1.819.924 | 0,24 |
| 740.000 | Zayo Group Holdings Inc** | 4,00 % | 01.03.2027 | 594.068 | 0,08 |
| 1.930.000 | ZF North America Capital Inc** | 4,75 % | 29.04.2025 | 1.909.339 | 0,26 |
| 1.860.000 | ZF North America Capital Inc** | 6,88 % | 14.04.2028 | 1.928.623 | 0,26 |
| Unternehmensanleihen insgesamt | | | | 664.013.737 | 89,20 |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen 1,80 % (31. Dezember 2022: 4,24 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 397.000 | AAAdvantage Loyalty IP Ltd | 10,43 % | 20.04.2028 | 408.446 | 0,06 |
| 688.714 | AppLovin Corp | 8,56 % | 25.10.2028 | 690.050 | 0,09 |
| 643.874 | CQP Holdco LP | 8,35 % | 31.12.2030 | 646.144 | 0,09 |
| 2.311.824 | Engineered Machinery Holdings Inc | 11,61 % | 21.05.2029 | 2.184.674 | 0,29 |
| 242.157 | First Brands Group LLC | 10,88 % | 30.03.2027 | 240.644 | 0,03 |
| 518.778 | Gates Global LLC | 7,96 % | 31.03.2027 | 520.261 | 0,07 |
| 875.526 | Gen Digital Inc | 7,46 % | 12.09.2029 | 877.850 | 0,12 |
| 207.331 | GYP Holdings III Corp | 8,36 % | 12.05.2030 | 208.433 | 0,03 |
| 623.762 | Ingram Micro Inc | 8,61 % | 30.06.2028 | 626.491 | 0,08 |
| 478.776 | McGraw-Hill Education Inc | 10,22 % | 28.07.2028 | 478.926 | 0,06 |
| 1.512.421 | Medline Borrower LP | 8,47 % | 23.10.2028 | 1.521.753 | 0,21 |
| 916.305 | MKS Instruments Inc | 7,84 % | 17.08.2029 | 919.988 | 0,12 |
| 1.558.217 | Nautilus Power LLC | 10,86 % | 16.11.2026 | 1.274.676 | 0,17 |
| 690.618 | Peraton Corp | 9,21 % | 01.02.2028 | 693.208 | 0,09 |
| 1.077.279 | Petco Health and Wellness Co Inc | 8,86 % | 03.03.2028 | 1.021.395 | 0,14 |
| 935.000 | Star Parent Inc | 9,35 % | 27.09.2030 | 926.300 | 0,13 |
| 179.765 | TransDigm Inc | 8,60 % | 24.08.2028 | 180.808 | 0,02 |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen insgesamt † | | | | 13.420.047 | 1,80 |

Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|---|-----------------------------------|--------------------|------------------------------|
| Investmentfonds 0,03 % (31. Dezember 2022: 0,22 %) | | | |
| Britisches Pfund | | | |
| 270.876 | NB Global Monthly Income Fund Ltd | 241.028 | 0,03 |
| Investmentfonds insgesamt [#] | | 241.028 | 0,03 |
| Anlagen insgesamt | | 677.674.812 | 91,03 |

Devisenterminkontrakte 2,05 % (31. Dezember 2022: 4,13 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeits- datum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettöver- mögens |
|---------------------------------|------------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> | | | | | | |
| 20.022 AUD | 13.250 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | 419 | 0,00 |
| 1.267.061 AUD | 815.990 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 9 | 49.040 | 0,01 |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> | | | | | | |
| 5.921 CHF | 6.826 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 220 | 0,00 |
| 24.798 CHF | 28.072 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 5 | 1.440 | 0,00 |
| 1.527.925 CHF | 1.708.033 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 4 | 110.322 | 0,02 |
| <i>Abgesicherte Klassen CNY</i> | | | | | | |
| 59.248 CNY | 8.204 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 4 | 126 | 0,00 |
| 2.536.061 CNY | 349.124 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 6 | 7.422 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 709.472 € | 755.896 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 28.310 | 0,00 |
| 81.921.988 € | 87.350.544 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 6 | 3.200.905 | 0,43 |
| 84.128.760 € | 89.660.938 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 39 | 3.329.737 | 0,45 |
| 44.029 US\$ | 39.623 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | 233 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 59.631.949 £ | 73.251.235 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 4 | 2.774.238 | 0,37 |
| 4.650.083 £ | 5.739.514 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 34 | 188.933 | 0,03 |
| 9 US\$ | 7 £ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 0 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen HKD</i> | | | | | | |
| 21.546 HKD | 2.757 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | 3 | 0,00 |
| 27.407 HKD | 3.508 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | 3 | 0,00 |
| 1.493.658 HKD | 191.237 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 4 | 114 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen JPY</i> | | | | | | |
| 217.947.720 ¥ | 1.520.952 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | 28.725 | 0,00 |
| 631.415.139 ¥ | 4.323.421 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 5 | 166.136 | 0,02 |
| 18.634.006.546 ¥ | 127.207.191 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 7 | 5.286.400 | 0,71 |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i> | | | | | | |
| 3.400.398 SGD | 2.502.621 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | 77.081 | 0,01 |
| 27.183 SGD | 20.425 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | 197 | 0,00 |

Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 2,05 % (31. Dezember 2022: 4,13 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|----------------------|-----------|--------------------------------|-----------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen SGD (Fortsetzung)</i> | | | | | | |
| 516.163 SGD | 386.669 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 34 | 4.916 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | 15.254.920 | 2,05 |
| | | | | | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | | | | | 692.929.732 | 93,08 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,42 %) (31. Dezember 2022: (0,95 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 2.706.048 US\$ | 2.216.332 € | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (119.580) | (0,02) |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> | | | | | | |
| 9.898 US\$ | 15.583 AUD | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (740) | (0,00) |
| 84.937 US\$ | 130.598 AUD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 4 | (4.223) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> | | | | | | |
| 5.015 US\$ | 4.462 CHF | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (295) | (0,00) |
| 4.873 US\$ | 4.306 CHF | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (252) | (0,00) |
| 973.224 US\$ | 869.131 CHF | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 4 | (61.112) | (0,01) |
| <i>Abgesicherte Klassen CNY</i> | | | | | | |
| 12.851 CNY | 1.810 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (3) | (0,00) |
| 78.835 US\$ | 572.752 CNY | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 6 | (1.688) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 22.204 € | 24.678 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (136) | (0,00) |
| 721.750 US\$ | 682.768 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (32.939) | (0,00) |
| 27.314.082 US\$ | 25.628.592 € | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (1.014.163) | (0,14) |
| 34.056.200 US\$ | 31.921.213 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 71 | (1.227.515) | (0,16) |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 364.138 € | 465.774 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (1.531) | (0,00) |
| 738 € | 942 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (1) | (0,00) |
| 461.832 US\$ | 380.253 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (22.957) | (0,00) |
| 5.349.117 US\$ | 4.355.860 € | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | (204.221) | (0,03) |
| 1.728.764 US\$ | 1.415.716 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 18 | (76.149) | (0,01) |
| <i>Abgesicherte Klassen HKD</i> | | | | | | |
| 13.704 HKD | 1.757 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (1) | (0,00) |
| 8.471 HKD | 1.086 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (0) | (0,00) |
| 2.489 US\$ | 19.454 HKD | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | (3) | (0,00) |

Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (0,42 %) (31. Dezember 2022: (0,95 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen JPY</i> | | | | | | |
| 766.864 US\$ | 113.274.004 ¥ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (38.550) | (0,01) |
| 6.185.450 US\$ | 911.327.371 ¥ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 7 | (294.372) | (0,04) |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i> | | | | | | |
| 267.211 SGD | 203.130 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (411) | (0,00) |
| 359.457 US\$ | 488.407 SGD | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (11.071) | (0,00) |
| 82.978 US\$ | 112.239 SGD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 16 | (2.172) | (0,00) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | (3.114.085) | (0,42) |
| | | | | | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | | | | | (3.114.085) | (0,42) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | | | | | 689.815.647 | 92,66 |
| Sonstiges Nettovermögen | | | | | 54.618.800 | 7,34 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | | | | | 744.434.447 | 100,00 |
| Portfolioanalyse | | | | | US\$ | % des Gesamtvermögens |
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | | | | | 82.006.991 | 10,79 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | | | | | 579.728.246 | 76,30 |
| † Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente | | | | | 15.698.547 | 2,07 |
| μ Investmentfonds | | | | | 241.028 | 0,03 |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente | | | | | 12.140.835 | 1,60 |
| Anlagen insgesamt | | | | | 689.815.647 | 90,79 |

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | | | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|--|---|--------|------------|--------------------|------------------------------|
| Aktien 0,00 % (31. Dezember 2022: 0,00 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 1.792 | GTT Communications Inc | | | 22.512 | 0,00 |
| Aktien insgesamt * | | | | 22.512 | 0,00 |
| Schatzwechsel 10,95 % (31. Dezember 2022: 0,61 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 121.655.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 11.01.2024 | 121.496.184 | 6,01 |
| 20.275.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 22.02.2024 | 20.124.424 | 1,00 |
| 50.000.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 14.03.2024 | 49.481.650 | 2,45 |
| 30.410.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 21.03.2024 | 30.063.872 | 1,49 |
| Schatzwechsel insgesamt ** | | | | 221.166.130 | 10,95 |
| Agency Bonds 0,04 % (31. Dezember 2022: 0,06 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 690.000 | Federal National Mortgage Association | 5,63 % | 15.07.2037 | 781.434 | 0,04 |
| Agency Bonds insgesamt ** | | | | 781.434 | 0,04 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 10,45 % (31. Dezember 2022: 7,97 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 3.599.000 | Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC Class B | 3,55 % | 22.09.2025 | 3.543.227 | 0,18 |
| 3.110.000 | BXP Trust 2017-GM Class A | 3,38 % | 13.06.2039 | 2.894.154 | 0,14 |
| 1.470.076 | Carlyle Global Market Strategies CLO 2014-5 Ltd Series 2014-5X Class A1RR | 6,72 % | 15.07.2031 | 1.474.224 | 0,07 |
| 1.026.597 | Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-375P Class A | 3,25 % | 10.05.2035 | 969.829 | 0,05 |
| 19.510.509 | Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC25 Class XA | 0,94 % | 10.10.2047 | 61.185 | 0,00 |
| 14.296.768 | Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC27 Class XA | 1,30 % | 10.02.2048 | 129.617 | 0,01 |
| 970.000 | Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8 Class C | 4,26 % | 15.09.2050 | 820.088 | 0,04 |
| 1.975.000 | COMM 2013-CCRE8 Mortgage Trust Class D | 3,60 % | 10.06.2046 | 1.798.019 | 0,09 |
| 5.140.378 | COMM 2014-CCRE16 Mortgage Trust Class XA | 0,92 % | 10.04.2047 | 2.175 | 0,00 |
| 7.494.288 | COMM 2014-CCRE17 Mortgage Trust Class XA | 0,87 % | 10.05.2047 | 1.024 | 0,00 |
| 2.300.000 | COMM 2014-CCRE21 Mortgage Trust Class AM | 3,99 % | 10.12.2047 | 2.185.393 | 0,11 |
| 10.643.710 | COMM 2014-LC15 Mortgage Trust Class XA | 0,00 % | 10.04.2047 | 685 | 0,00 |
| 1.675.846 | COMM 2014-UBS3 Mortgage Trust Class XA | 1,04 % | 10.06.2047 | 354 | 0,00 |
| 12.559.941 | COMM 2014-UBS6 Mortgage Trust Class XA | 0,82 % | 10.12.2047 | 48.687 | 0,00 |
| 629.000 | COMM 2015-CCRE24 Mortgage Trust Class B | 4,35 % | 10.08.2048 | 590.052 | 0,03 |
| 1.880.000 | Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R01 Class 1B1 | 8,70 % | 25.01.2040 | 1.904.466 | 0,09 |
| 5.101.348 | Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01 Class 1B1 | 8,44 % | 25.10.2041 | 5.151.715 | 0,26 |
| 4.175.000 | Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R03 Class 1B1 | 8,09 % | 25.12.2041 | 4.193.434 | 0,21 |
| 4.538.000 | Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R01 Class 1B1 | 8,49 % | 25.12.2041 | 4.579.112 | 0,23 |

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 10,45 % (31. Dezember 2022: 7,97 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 3.725.000 | Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R01 Class 1M2 | 7,24 % | 25.12.2041 | 3.736.641 | 0,18 |
| 2.558.000 | Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R02 Class 2B1 | 9,84 % | 25.01.2042 | 2.639.616 | 0,13 |
| 1.855.652 | Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R02 Class 2M2 | 8,34 % | 25.01.2042 | 1.883.609 | 0,09 |
| 5.195.000 | Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R03 Class 1M2 | 8,84 % | 25.03.2042 | 5.437.883 | 0,27 |
| 2.119.000 | Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R04 Class 1M2 | 8,44 % | 25.03.2042 | 2.190.499 | 0,11 |
| 609.000 | Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R08 Class 1M2 | 8,94 % | 25.07.2042 | 639.515 | 0,03 |
| 753.000 | CSAIL 2018-C14 Commercial Mortgage Trust Class C | 4,90 % | 15.11.2051 | 601.269 | 0,03 |
| 1.409.000 | Eleven Madison Trust 2015-11MD Mortgage Trust Class A | 3,55 % | 10.09.2035 | 1.268.985 | 0,06 |
| 6.500.000 | Empower CLO 2023-3 Ltd Series 2023-3X Class A | 7,19 % | 20.01.2037 | 6.501.278 | 0,32 |
| 4.689.477 | Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 1M2 | 7,80 % | 25.01.2031 | 4.804.862 | 0,24 |
| 1.031.468 | Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 2M2 | 7,65 % | 25.08.2030 | 1.047.103 | 0,05 |
| 3.500.682 | Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 2M2 | 8,00 % | 25.12.2030 | 3.599.102 | 0,18 |
| 3.859.928 | Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 2M2 | 8,25 % | 25.02.2030 | 3.987.728 | 0,20 |
| 3.397.404 | Fannie Mae Interest Strip Class C24 | 4,00 % | 25.08.2043 | 627.323 | 0,03 |
| 2.633.389 | Fannie Mae Interest Strip Class C26 | 4,00 % | 25.10.2041 | 465.628 | 0,02 |
| 5.980.619 | Fannie Mae REMICS Class AI | 3,50 % | 25.11.2051 | 1.004.070 | 0,05 |
| 2.870.601 | Fannie Mae REMICS Class DS | 0,70 % | 25.06.2043 | 382.984 | 0,02 |
| 1.825.365 | Fannie Mae REMICS Class HS | 0,55 % | 25.06.2046 | 237.204 | 0,01 |
| 3.059.368 | Fannie Mae REMICS Class SA | 0,55 % | 25.09.2046 | 364.474 | 0,02 |
| 1.734.596 | Fannie Mae REMICS Class SB | 0,65 % | 25.03.2046 | 182.141 | 0,01 |
| 2.770.014 | Fannie Mae REMICS Class SN | 0,65 % | 25.07.2049 | 323.690 | 0,02 |
| 3.015.370 | Fannie Mae REMICS Class ST | 0,65 % | 25.12.2044 | 357.936 | 0,02 |
| 3.005.606 | Fannie Mae REMICS Class SY | 0,70 % | 25.07.2043 | 377.381 | 0,02 |
| 1.829.834 | Freddie Mac REMICS Class BI | 4,50 % | 25.02.2050 | 360.930 | 0,02 |
| 1.684.266 | Freddie Mac REMICS Class EC | 1,50 % | 25.02.2049 | 1.348.553 | 0,07 |
| 1.689.018 | Freddie Mac REMICS Class LI | 4,00 % | 25.12.2048 | 313.493 | 0,02 |
| 1.031.817 | Freddie Mac REMICS Class SA | 0,55 % | 15.10.2046 | 138.239 | 0,01 |
| 1.485.861 | Freddie Mac REMICS Class SA | 0,70 % | 15.03.2045 | 188.423 | 0,01 |
| 2.489.445 | Freddie Mac REMICS Class SP | 0,70 % | 15.01.2043 | 251.126 | 0,01 |
| 2.581.000 | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA6 Class B1 | 8,74 % | 25.10.2041 | 2.627.434 | 0,13 |
| 4.261.000 | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA7 Class B1 | 8,99 % | 25.11.2041 | 4.347.895 | 0,22 |
| 3.695.000 | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-HQA4 Class B1 | 9,09 % | 25.12.2041 | 3.698.325 | 0,18 |
| 6.883.000 | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA1 Class M2 | 7,84 % | 25.01.2042 | 6.883.825 | 0,34 |
| 3.673.038 | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA2 Class M2 | 9,09 % | 25.02.2042 | 3.799.660 | 0,19 |
| 3.749.162 | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA3 Class M1B | 8,24 % | 25.04.2042 | 3.857.084 | 0,19 |
| 963.000 | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA5 Class M1B | 9,84 % | 25.06.2042 | 1.038.881 | 0,05 |
| 2.373.000 | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-HQA1 Class M1B | 8,84 % | 25.03.2042 | 2.461.222 | 0,12 |
| 4.211.000 | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-HQA1 Class M2 | 10,59 % | 25.03.2042 | 4.499.459 | 0,22 |
| 2.635.000 | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-HQA3 Class M1B | 8,89 % | 25.08.2042 | 2.730.339 | 0,14 |

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 10,45 % (31. Dezember 2022: 7,97 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 1.033.831 | Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes Class M2 | 7,25 % | 25.07.2030 | 1.040.934 | 0,05 |
| 4.494.726 | Government National Mortgage Association Class AB | 1,00 % | 20.07.2050 | 3.447.097 | 0,17 |
| 9.316.913 | Government National Mortgage Association Class CI | 2,00 % | 20.10.2050 | 1.052.841 | 0,05 |
| 7.269.560 | Government National Mortgage Association Class DI | 2,50 % | 20.02.2051 | 994.306 | 0,05 |
| 3.303.686 | Government National Mortgage Association Class HE | 2,00 % | 20.06.2051 | 2.743.487 | 0,14 |
| 7.363.891 | Government National Mortgage Association Class HS | 0,73 % | 20.10.2045 | 947.617 | 0,05 |
| 4.880.710 | Government National Mortgage Association Class IE | 3,50 % | 20.08.2051 | 822.545 | 0,04 |
| 6.629.979 | Government National Mortgage Association Class IO | 2,50 % | 20.11.2051 | 909.762 | 0,04 |
| 3.752.094 | Government National Mortgage Association Class KA | 1,00 % | 20.08.2050 | 2.873.638 | 0,14 |
| 2.463.656 | Government National Mortgage Association Class KS | 0,73 % | 20.07.2047 | 313.971 | 0,02 |
| 3.330.027 | Government National Mortgage Association Class NC | 1,50 % | 20.07.2051 | 2.725.233 | 0,13 |
| 1.541.688 | Government National Mortgage Association Class SA | 0,63 % | 16.12.2043 | 181.785 | 0,01 |
| 3.555.619 | Government National Mortgage Association Class WK | 1,00 % | 20.06.2050 | 2.723.210 | 0,13 |
| 1.898.408 | GS Mortgage Securities Trust 2014-GC18 Class XA | 0,81 % | 10.01.2047 | 94 | 0,00 |
| 9.930.622 | GS Mortgage Securities Trust 2014-GC26 Class XA | 0,99 % | 10.11.2047 | 45.552 | 0,00 |
| 9.721.261 | GS Mortgage Securities Trust 2015-GC30 Class XA | 0,72 % | 10.05.2050 | 67.532 | 0,00 |
| 2.110.000 | GS Mortgage Securities Trust 2015-GS1 Class AS | 4,04 % | 10.11.2048 | 1.899.273 | 0,09 |
| 2.514.000 | GS Mortgage Securities Trust 2016-GS4 Class B | 3,85 % | 10.11.2049 | 2.243.137 | 0,11 |
| 2.996.112 | Hilton Grand Vacations Trust 2018-A Class A | 3,54 % | 25.02.2032 | 2.916.731 | 0,14 |
| 1.748.000 | Hilton USA Trust 2016-HHV Class C | 4,19 % | 05.11.2038 | 1.659.877 | 0,08 |
| 1.914.000 | Hilton USA Trust 2016-HHV Class D | 4,19 % | 05.11.2038 | 1.794.579 | 0,09 |
| 1.425.000 | Hilton USA Trust 2016-HHV Class E | 4,19 % | 05.11.2038 | 1.319.281 | 0,07 |
| 7.000.000 | HPS Loan Management 2023-17 Ltd Series 2023-17X Class A | 7,22 % | 23.04.2036 | 7.045.637 | 0,35 |
| 1.800.000 | Hudson Yards 2016-10HY Mortgage Trust Class C | 2,98 % | 10.08.2038 | 1.636.212 | 0,08 |
| 500.000 | Hudson Yards 2016-10HY Mortgage Trust Class E | 2,98 % | 10.08.2038 | 440.229 | 0,02 |
| 2.775.000 | J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2016-NINE Class A | 2,85 % | 06.09.2038 | 2.565.729 | 0,13 |
| 1.135.000 | JP Morgan Mortgage Trust 2023-HE3 Class M1 | 7,44 % | 25.05.2054 | 1.137.837 | 0,06 |
| 321.000 | JP Morgan Mortgage Trust 2023-HE3 Class M2 | 7,84 % | 25.05.2054 | 321.803 | 0,02 |
| 439.256 | Laurel Road Prime Student Loan Trust 2017-B Class BFX | 3,02 % | 25.08.2042 | 428.551 | 0,02 |
| 890.415 | Magnetite VII Ltd Series 2012-7X Class A1R2 | 6,38 % | 15.01.2028 | 890.280 | 0,04 |
| 2.433.000 | MetroNet Infrastructure Issuer LLC Class A2 | 6,35 % | 20.10.2052 | 2.397.369 | 0,12 |
| 1.200.000 | Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Securities Trust 2017-C33 Class C | 4,56 % | 15.05.2050 | 1.043.427 | 0,05 |
| 2.726.000 | Morgan Stanley Capital I Trust 2017-H1 Class C | 4,28 % | 15.06.2050 | 2.278.285 | 0,11 |
| 2.340.000 | Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H4 Class C | 5,06 % | 15.12.2051 | 1.965.634 | 0,10 |
| 2.447.239 | OBX Trust Series 2023-NQM7 Class A1 | 6,84 % | 25.04.2063 | 2.496.543 | 0,12 |
| 4.079.817 | OCP CLO 2014-5 Ltd Class A1R | 6,72 % | 26.04.2031 | 4.081.289 | 0,20 |
| 469.338 | Octagon Investment Partners 35 Ltd Series 2018-1X Class A1A | 6,64 % | 20.01.2031 | 469.655 | 0,02 |
| 3.337.000 | OneMain Financial Issuance Trust 2022-2 Class A | 4,89 % | 14.10.2034 | 3.296.798 | 0,16 |
| 98.419 | Securitized Asset Backed Receivables LLC Trust 2004-DO1 Class M1 | 6,45 % | 25.07.2034 | 102.903 | 0,01 |
| 2.490.000 | Shops at Crystals Trust 2016-CSTL Class A | 3,13 % | 05.07.2036 | 2.324.413 | 0,12 |

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 10,45 % (31. Dezember 2022: 7,97 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 99.126 | SoFi Professional Loan Program 2017-D LLC Class A2FX | 2,65 % | 25.09.2040 | 95.427 | 0,00 |
| 1.007.755 | SoFi Professional Loan Program 2017-E LLC Class B | 3,49 % | 26.11.2040 | 970.579 | 0,05 |
| 900.000 | Sofi Professional Loan Program 2017-F LLC Class BFX | 3,62 % | 25.01.2041 | 817.681 | 0,04 |
| 3.000.000 | Sofi Professional Loan Program 2018-A LLC Class B | 3,61 % | 25.02.2042 | 2.739.253 | 0,14 |
| 650.000 | Sofi Professional Loan Program 2018-D Trust Class BFX | 4,14 % | 25.02.2048 | 593.405 | 0,03 |
| 4.334.828 | Taco Bell Funding LLC Class A2II | 4,94 % | 25.11.2048 | 4.232.253 | 0,21 |
| 7.000.000 | Trinitas CLO XXIII Ltd Series 2023-23X Class A | 7,12 % | 20.10.2036 | 7.014.474 | 0,35 |
| 5.984.450 | Voya CLO 2014-1 Ltd Series 2014-1X Class | 6,55 % | 18.04.2031 | 5.978.242 | 0,30 |
| 3.320.000 | Wellington Management CLO 1 Ltd Series 2023-1X Class A | 7,12 % | 20.10.2036 | 3.325.609 | 0,16 |
| 1.941.000 | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS4 Class C | 4,68 % | 15.12.2048 | 1.784.374 | 0,09 |
| 1.189.000 | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS6 Class B | 3,81 % | 15.11.2049 | 1.071.250 | 0,05 |
| 3.175.000 | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS6 Class C | 4,39 % | 15.11.2049 | 2.769.022 | 0,14 |
| 425.000 | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-C47 Class C | 4,92 % | 15.09.2061 | 360.481 | 0,02 |
| 8.186.983 | WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C21 Class XA | 0,98 % | 15.08.2047 | 39.392 | 0,00 |
| 14.357.361 | WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C22 Class XA | 0,76 % | 15.09.2057 | 42.057 | 0,00 |
| 1.463.303 | WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-LC14 Class XA | 1,13 % | 15.03.2047 | 93 | 0,00 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt ** | | | | 211.031.917 | 10,45 |
| Unternehmensanleihen 26,53 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) | | | | | |
| Euro | | | | | |
| 179.000 | 888 Acquisitions Ltd** | 7,56 % | 15.07.2027 | 189.278 | 0,01 |
| 2.400.000 | Abertis Infraestructuras Finance BV* | 3,25 % | 29.12.2049 | 2.551.476 | 0,13 |
| 100.000 | Accor SA* | 7,25 % | 29.12.2049 | 120.457 | 0,01 |
| 74.727 | Adient Global Holdings Ltd* | 3,50 % | 15.08.2024 | 81.963 | 0,00 |
| 385.000 | Allwyn International AS** | 3,88 % | 15.02.2027 | 410.405 | 0,02 |
| 440.000 | Altice Financing SA** | 4,25 % | 15.08.2029 | 432.673 | 0,02 |
| 189.000 | Altice France Holding SA* | 4,00 % | 15.02.2028 | 93.082 | 0,00 |
| 620.000 | Altice France SA** | 4,13 % | 15.01.2029 | 549.312 | 0,03 |
| 100.000 | Altice France SA** | 4,25 % | 15.10.2029 | 88.312 | 0,00 |
| 100.000 | APA Infrastructure Ltd* | 7,13 % | 09.11.2083 | 116.277 | 0,01 |
| 469.000 | Aramark International Finance Sarl* | 3,13 % | 01.04.2025 | 516.932 | 0,03 |
| 246.000 | Assemblin Group AB** | 8,96 % | 05.07.2029 | 276.437 | 0,01 |
| 943.000 | AusNet Services Holdings Pty Ltd* | 1,63 % | 11.03.2081 | 942.759 | 0,05 |
| 210.000 | Avantor Funding Inc* | 3,88 % | 15.07.2028 | 227.857 | 0,01 |
| 240.000 | Avis Budget Finance Plc** | 7,25 % | 31.07.2030 | 284.614 | 0,01 |
| 1.987.000 | Banjay Entertainment SASU** | 7,00 % | 01.05.2029 | 2.320.883 | 0,11 |
| 2.200.000 | Bayer AG* | 5,38 % | 25.03.2082 | 2.315.992 | 0,11 |
| 1.700.000 | Bayer AG* | 6,63 % | 25.09.2083 | 1.918.524 | 0,09 |
| 100.000 | Bayer AG* | 7,00 % | 25.09.2083 | 114.314 | 0,01 |
| 300.000 | BCP V Modular Services Finance II Plc** | 4,75 % | 30.11.2028 | 308.820 | 0,02 |

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 26,53 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Euro (Fortsetzung) | | | | | |
| 168.000 | Benteler International AG [*] | 9,38 % | 15.05.2028 | 198.715 | 0,01 |
| 1.900.000 | Birkenstock Financing Sarl [*] | 5,25 % | 30.04.2029 | 2.093.250 | 0,10 |
| 162.000 | Boels Topholding BV ^{**} | 6,25 % | 15.02.2029 | 187.461 | 0,01 |
| 400.000 | CECONOMY AG [*] | 1,75 % | 24.06.2026 | 385.069 | 0,02 |
| 415.000 | Cheplapharm Arzneimittel GmbH ^{**} | 4,38 % | 15.01.2028 | 448.013 | 0,02 |
| 234.000 | Cheplapharm Arzneimittel GmbH [*] | 7,50 % | 15.05.2030 | 276.043 | 0,01 |
| 547.000 | Cirsa Finance International Sarl [*] | 4,50 % | 15.03.2027 | 583.221 | 0,03 |
| 1.642.000 | Cirsa Finance International Sarl [*] | 7,88 % | 31.07.2028 | 1.897.224 | 0,09 |
| 200.000 | Clarios Global LP/Clarios US Finance Co ^{**} | 4,38 % | 15.05.2026 | 219.814 | 0,01 |
| 325.000 | Coty Inc ^{**} | 3,88 % | 15.04.2026 | 359.113 | 0,02 |
| 185.000 | Ctec II GmbH ^{**} | 5,25 % | 15.02.2030 | 183.623 | 0,01 |
| 1.542.000 | Dana Financing Luxembourg Sarl [*] | 8,50 % | 15.07.2031 | 1.868.596 | 0,09 |
| 400.000 | Deutsche Lufthansa AG [*] | 3,00 % | 29.05.2026 | 431.040 | 0,02 |
| 300.000 | Deutsche Lufthansa AG [*] | 3,75 % | 11.02.2028 | 327.691 | 0,02 |
| 210.000 | Douglas GmbH [*] | 6,00 % | 08.04.2026 | 229.873 | 0,01 |
| 2.206.000 | Dufry One BV [*] | 3,38 % | 15.04.2028 | 2.330.922 | 0,12 |
| 500.000 | EDP - Energias de Portugal SA [*] | 5,94 % | 23.04.2083 | 574.711 | 0,03 |
| 371.000 | eircom Finance DAC ^{**} | 3,50 % | 15.05.2026 | 399.588 | 0,02 |
| 800.000 | Electricite de France SA [*] | 2,63 % | 29.12.2049 | 788.345 | 0,04 |
| 2.600.000 | Electricite de France SA [*] | 7,50 % | 29.12.2049 | 3.142.784 | 0,16 |
| 1.900.000 | Elia Group SA [*] | 5,85 % | 29.12.2049 | 2.138.335 | 0,11 |
| 151.000 | Emerald Debt Merger Sub LLC ^{**} | 6,38 % | 15.12.2030 | 178.821 | 0,01 |
| 186.000 | Enel SpA [*] | 6,38 % | 29.12.2049 | 215.313 | 0,01 |
| 373.000 | Energia Group Roi Financeco DAC ^{**} | 6,88 % | 31.07.2028 | 428.753 | 0,02 |
| 427.000 | Eroski S Coop [*] | 10,63 % | 30.04.2029 | 487.161 | 0,02 |
| 200.000 | Fiber Bidco SpA [*] | 11,00 % | 25.10.2027 | 241.760 | 0,01 |
| 175.000 | Ford Motor Credit Co LLC [*] | 4,87 % | 03.08.2027 | 198.917 | 0,01 |
| 200.000 | Forvia SE [*] | 2,63 % | 15.06.2025 | 217.283 | 0,01 |
| 279.000 | Forvia SE [*] | 2,75 % | 15.02.2027 | 295.649 | 0,01 |
| 360.000 | Gruenthal GmbH [*] | 3,63 % | 15.11.2026 | 393.364 | 0,02 |
| 390.000 | Heimstaden Bostad AB [*] | 3,25 % | 29.12.2049 | 226.347 | 0,01 |
| 250.000 | Heimstaden Bostad Treasury BV [*] | 1,63 % | 13.10.2031 | 175.193 | 0,01 |
| 2.258.000 | IHO Verwaltungs GmbH [*] | 3,88 % | 15.05.2027 | 2.449.300 | 0,12 |
| 279.000 | IHO Verwaltungs GmbH [*] | 8,75 % | 15.05.2028 | 336.525 | 0,02 |
| 600.000 | Iliad Holding SASU ^{**} | 5,13 % | 15.10.2026 | 662.359 | 0,03 |
| 1.703.000 | Iliad Holding SASU ^{**} | 5,63 % | 15.10.2028 | 1.893.277 | 0,09 |
| 100.000 | INEOS Finance Plc [*] | 2,88 % | 01.05.2026 | 107.385 | 0,01 |
| 720.000 | INEOS Finance Plc [*] | 3,38 % | 31.03.2026 | 782.568 | 0,04 |
| 1.030.000 | INEOS Quattro Finance 1 Plc [*] | 3,75 % | 15.07.2026 | 1.101.445 | 0,05 |
| 200.000 | Infineon Technologies AG [*] | 2,88 % | 29.12.2049 | 216.171 | 0,01 |

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 26,53 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Euro (Fortsetzung) | | | | | |
| 400.000 | International Consolidated Airlines Group SA [*] | 3,75 % | 25.03.2029 | 428.343 | 0,02 |
| 199.000 | Intrum AB [*] | 3,00 % | 15.09.2027 | 168.109 | 0,01 |
| 200.000 | Intrum AB [*] | 3,50 % | 15.07.2026 | 188.087 | 0,01 |
| 157.000 | IPD 3 BV [*] | 8,00 % | 15.06.2028 | 185.584 | 0,01 |
| 2.225.000 | Jaguar Land Rover Automotive Plc [*] | 4,50 % | 15.07.2028 | 2.406.534 | 0,12 |
| 259.000 | Kapla Holding SAS [*] | 3,38 % | 15.12.2026 | 277.658 | 0,01 |
| 100.000 | Kapla Holding SAS [*] | 9,47 % | 15.07.2027 | 112.826 | 0,01 |
| 185.000 | Koninklijke KPN NV [*] | 6,00 % | 29.12.2049 | 212.250 | 0,01 |
| 295.000 | Kronos International Inc ^{**} | 3,75 % | 15.09.2025 | 313.601 | 0,02 |
| 208.000 | LHMC Finco 2 Sarl [*] | 7,25 % | 02.10.2025 | 228.934 | 0,01 |
| 3.705.000 | Lorca Telecom Bondco SA [*] | 4,00 % | 18.09.2027 | 4.004.486 | 0,20 |
| 100.000 | Lottomatica SpA ^{**} | 7,93 % | 15.12.2030 | 111.675 | 0,01 |
| 200.000 | Loxam SAS [*] | 5,75 % | 15.07.2027 | 218.080 | 0,01 |
| 200.000 | Loxam SAS [*] | 6,38 % | 15.05.2028 | 230.629 | 0,01 |
| 100.000 | Loxam SAS [*] | 6,38 % | 31.05.2029 | 114.691 | 0,01 |
| 185.000 | Lune Holdings Sarl ^{**} | 5,63 % | 15.11.2028 | 167.259 | 0,01 |
| 215.000 | Monitchem HoldCo 3 SA [*] | 8,75 % | 01.05.2028 | 243.240 | 0,01 |
| 157.000 | Motion Finco Sarl [*] | 7,38 % | 15.06.2030 | 177.711 | 0,01 |
| 195.000 | Multiversity SRL [*] | 8,20 % | 30.10.2028 | 216.753 | 0,01 |
| 390.000 | Nidda Healthcare Holding GmbH ^{**} | 7,50 % | 21.08.2026 | 444.942 | 0,02 |
| 275.000 | Olympus Water US Holding Corp [*] | 3,88 % | 01.10.2028 | 279.248 | 0,01 |
| 100.000 | Olympus Water US Holding Corp ^{**} | 9,63 % | 15.11.2028 | 118.743 | 0,01 |
| 1.007.000 | Orsted AS [*] | 5,25 % | 29.12.2049 | 1.111.270 | 0,05 |
| 299.000 | PEU Finance Plc [*] | 7,25 % | 01.07.2028 | 340.699 | 0,02 |
| 150.000 | PLT VII Finance Sarl ^{**} | 4,63 % | 05.01.2026 | 165.203 | 0,01 |
| 360.000 | Q-Park Holding I BV ^{**} | 1,50 % | 01.03.2025 | 390.495 | 0,02 |
| 159.000 | Repsol International Finance BV [*] | 4,25 % | 29.12.2049 | 171.990 | 0,01 |
| 100.000 | Schaeffler AG [*] | 3,38 % | 12.10.2028 | 107.265 | 0,01 |
| 460.000 | SES SA [*] | 2,88 % | 29.12.2049 | 463.490 | 0,02 |
| 659.000 | Southern Co [*] | 1,88 % | 15.09.2081 | 626.115 | 0,03 |
| 2.000.000 | SSE Plc [*] | 4,00 % | 29.12.2049 | 2.146.434 | 0,11 |
| 874.000 | Stedin Holding NV [*] | 1,50 % | 29.12.2049 | 869.702 | 0,04 |
| 217.000 | Summer BC Holdco B Sarl ^{**} | 5,75 % | 31.10.2026 | 230.192 | 0,01 |
| 200.000 | Synthomer Plc [*] | 3,88 % | 01.07.2025 | 219.052 | 0,01 |
| 373.659 | Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH ^{**} | 6,00 % | 30.07.2026 | 413.084 | 0,02 |
| 100.000 | Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH ^{**} | 2,00 % | 15.07.2025 | 108.314 | 0,01 |
| 200.000 | Telecom Italia SpA ^{**} | 3,00 % | 30.09.2025 | 216.123 | 0,01 |
| 2.220.000 | Telecom Italia SpA [*] | 7,88 % | 31.07.2028 | 2.730.441 | 0,13 |
| 400.000 | Telefonica Europe BV [*] | 6,75 % | 29.12.2049 | 472.824 | 0,02 |
| 200.000 | Telefonica Europe BV [*] | 7,13 % | 29.12.2049 | 239.063 | 0,01 |

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 26,53 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Euro (Fortsetzung) | | | | | |
| 1.085.000 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV* | 3,75 % | 09.05.2027 | 1.157.936 | 0,06 |
| 1.863.000 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV* | 4,38 % | 09.05.2030 | 1.937.299 | 0,10 |
| 2.080.000 | TK Elevator Midco GmbH** | 4,38 % | 15.07.2027 | 2.228.997 | 0,11 |
| 700.000 | Unibail-Rodamco-Westfield SE* | 7,25 % | 29.12.2049 | 775.152 | 0,04 |
| 200.000 | United Group BV** | 4,63 % | 15.08.2028 | 209.997 | 0,01 |
| 300.000 | Valeo SE* | 5,38 % | 28.05.2027 | 344.698 | 0,02 |
| 100.000 | Valeo SE* | 5,88 % | 12.04.2029 | 118.722 | 0,01 |
| 945.000 | Verisure Holding AB* | 3,88 % | 15.07.2026 | 1.027.029 | 0,05 |
| 1.826.000 | Verisure Midholding AB* | 5,25 % | 15.02.2029 | 1.930.974 | 0,10 |
| 1.100.000 | Vodafone Group Plc* | 6,50 % | 30.08.2084 | 1.302.609 | 0,06 |
| 2.100.000 | Volkswagen International Finance NV* | 3,75 % | 29.12.2049 | 2.180.707 | 0,11 |
| 284.000 | WEPA Hygieneprodukte GmbH** | 2,88 % | 15.12.2027 | 294.529 | 0,01 |
| 300.000 | Wintershall Dea Finance 2 BV* | 3,00 % | 29.12.2049 | 290.261 | 0,01 |
| 220.000 | Wp/ap Telecom Holdings III BV** | 5,50 % | 15.01.2030 | 222.588 | 0,01 |
| 2.400.000 | ZF Europe Finance BV* | 3,00 % | 23.10.2029 | 2.447.352 | 0,12 |
| 300.000 | ZF Finance GmbH* | 3,75 % | 21.09.2028 | 320.525 | 0,02 |
| 634.000 | Ziggo Bond Co BV* | 3,38 % | 28.02.2030 | 593.289 | 0,03 |
| Euro insgesamt | | | | 82.785.192 | 4,10 |
| Britisches Pfund | | | | | |
| 200.000 | AA Bond Co Ltd* | 6,50 % | 31.01.2026 | 243.582 | 0,01 |
| 160.000 | AA Bond Co Ltd 144A* | 6,50 % | 31.01.2026 | 194.866 | 0,01 |
| 1.138.000 | AA Bond Co Ltd* | 8,45 % | 31.01.2028 | 1.524.290 | 0,08 |
| 320.000 | Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc* | 4,75 % | 15.07.2027 | 297.643 | 0,01 |
| 1.569.000 | B&M European Value Retail SA* | 8,13 % | 15.11.2030 | 2.134.922 | 0,11 |
| 1.989.000 | Bellis Acquisition Co Plc** | 3,25 % | 16.02.2026 | 2.359.942 | 0,12 |
| 205.000 | Bellis Finco Plc** | 4,00 % | 16.02.2027 | 228.244 | 0,01 |
| 2.386.000 | British Telecommunications Plc* | 8,38 % | 20.12.2083 | 3.219.513 | 0,16 |
| 200.000 | Castle UK Finco Plc** | 7,00 % | 15.05.2029 | 217.285 | 0,01 |
| 320.000 | Centrica Plc* | 5,25 % | 10.04.2075 | 403.868 | 0,02 |
| 130.000 | Constellation Automotive Financing Plc* | 4,88 % | 15.07.2027 | 136.742 | 0,01 |
| 200.000 | Co-operative Group Holdings 2011 Ltd* | 7,50 % | 08.07.2026 | 252.230 | 0,01 |
| 235.000 | CPUK Finance Ltd** | 6,50 % | 28.08.2026 | 290.546 | 0,01 |
| 525.000 | Encore Capital Group Inc* | 4,25 % | 01.06.2028 | 575.116 | 0,03 |
| 1.491.000 | GTCR W-2 Merger Sub LLC/GTCR W Dutch Finance Sub BV** | 8,50 % | 15.01.2031 | 2.060.863 | 0,10 |
| 100.000 | Iceland Bondco Plc** | 10,88 % | 15.12.2027 | 133.410 | 0,01 |
| 200.000 | Maison Finco Plc** | 6,00 % | 31.10.2027 | 221.302 | 0,01 |
| 340.000 | Mobico Group Plc* | 4,25 % | 29.12.2049 | 383.815 | 0,02 |
| 155.000 | NGG Finance Plc* | 5,63 % | 18.06.2073 | 195.334 | 0,01 |
| 200.000 | Pinewood Finance Co Ltd** | 3,25 % | 30.09.2025 | 248.444 | 0,01 |

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 26,53 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Britisches Pfund (Fortsetzung) | | | | | |
| 273.000 | Pinnacle Bidco Plc* | 10,00 % | 11.10.2028 | 362.595 | 0,02 |
| 165.000 | RAC Bond Co Plc** | 5,25 % | 04.11.2027 | 184.631 | 0,01 |
| 400.000 | Rolls-Royce Plc* | 5,75 % | 15.10.2027 | 513.107 | 0,02 |
| 200.000 | TVL Finance Plc** | 10,25 % | 28.04.2028 | 265.647 | 0,01 |
| 1.700.000 | Vattenfall AB* | 6,88 % | 17.08.2083 | 2.184.159 | 0,11 |
| 1.045.000 | Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC** | 4,88 % | 15.07.2028 | 1.229.475 | 0,06 |
| 264.000 | Vodafone Group Plc* | 4,88 % | 03.10.2078 | 327.943 | 0,02 |
| Britisches Pfund insgesamt | | | | 20.389.514 | 1,01 |
| US-Dollar | | | | | |
| 730.000 | 1011778 BC ULC/New Red Finance Inc** | 3,88 % | 15.01.2028 | 690.177 | 0,03 |
| 515.000 | 1011778 BC ULC/New Red Finance Inc** | 4,00 % | 15.10.2030 | 462.536 | 0,02 |
| 310.000 | 1011778 BC ULC/New Red Finance Inc** | 4,38 % | 15.01.2028 | 296.357 | 0,01 |
| 2.000.000 | ABN AMRO Bank NV** | 3,32 % | 13.03.2037 | 1.601.906 | 0,08 |
| 660.000 | ADT Security Corp** | 4,88 % | 15.07.2032 | 611.223 | 0,03 |
| 471.000 | AerCap Global Aviation Trust* | 6,50 % | 15.06.2045 | 472.267 | 0,02 |
| 2.905.000 | AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust* | 3,30 % | 30.01.2032 | 2.529.318 | 0,13 |
| 360.000 | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC** | 3,50 % | 15.03.2029 | 327.295 | 0,02 |
| 580.000 | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC** | 4,88 % | 15.02.2030 | 555.882 | 0,03 |
| 920.000 | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC** | 5,88 % | 15.02.2028 | 921.192 | 0,05 |
| 695.000 | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer** | 6,75 % | 15.10.2027 | 693.262 | 0,03 |
| 685.000 | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer** | 6,75 % | 15.04.2028 | 701.204 | 0,03 |
| 205.000 | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer** | 7,00 % | 15.01.2031 | 216.375 | 0,01 |
| 470.000 | Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl 144A** | 4,63 % | 01.06.2028 | 430.045 | 0,02 |
| 1.838.000 | Ally Financial Inc** | 4,70 % | 29.12.2049 | 1.251.600 | 0,06 |
| 1.745.000 | Ally Financial Inc Series B** | 4,70 % | 29.12.2049 | 1.314.311 | 0,07 |
| 1.210.000 | Altice France Holding SA** | 6,00 % | 15.02.2028 | 582.257 | 0,03 |
| 1.130.000 | Altice France SA* | 5,50 % | 15.01.2028 | 931.533 | 0,05 |
| 355.000 | American Airlines Inc** | 7,25 % | 15.02.2028 | 359.382 | 0,02 |
| 1.387.500 | American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd** | 5,50 % | 20.04.2026 | 1.378.511 | 0,07 |
| 1.765.000 | American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd** | 5,75 % | 20.04.2029 | 1.722.477 | 0,09 |
| 1.250.000 | American Express Co** | 3,55 % | 29.12.2049 | 1.074.750 | 0,05 |
| 1.975.000 | American Express Co** | 5,63 % | 28.07.2034 | 2.042.139 | 0,10 |
| 2.495.000 | Amgen Inc** | 2,77 % | 01.09.2053 | 1.603.181 | 0,08 |
| 1.745.000 | Amgen Inc** | 5,75 % | 02.03.2063 | 1.832.945 | 0,09 |
| 495.000 | AmWINS Group Inc** | 4,88 % | 30.06.2029 | 452.707 | 0,02 |
| 995.000 | APX Group Inc** | 5,75 % | 15.07.2029 | 928.871 | 0,05 |
| 310.000 | Aramark Services Inc** | 5,00 % | 01.02.2028 | 300.920 | 0,02 |
| 660.000 | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc** | 6,00 % | 15.06.2027 | 658.048 | 0,03 |
| 430.000 | Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc** | 5,25 % | 15.08.2027 | 334.557 | 0,02 |

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 26,53 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 875.000 | Ascension Health** | 3,11 % | 15.11.2039 | 687.358 | 0,03 |
| 615.000 | Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp** | 5,88 % | 30.06.2029 | 572.828 | 0,03 |
| 395.000 | Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp** | 7,00 % | 01.11.2026 | 398.098 | 0,02 |
| 910.000 | Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp** | 8,25 % | 31.12.2028 | 916.353 | 0,05 |
| 680.000 | ASGN Inc** | 4,63 % | 15.05.2028 | 646.426 | 0,03 |
| 515.000 | AssuredPartners Inc** | 5,63 % | 15.01.2029 | 481.349 | 0,02 |
| 895.000 | AssuredPartners Inc** | 7,00 % | 15.08.2025 | 897.468 | 0,04 |
| 3.875.000 | AT&T Inc** | 3,50 % | 15.09.2053 | 2.815.306 | 0,14 |
| 720.000 | AthenaHealth Group Inc** | 6,50 % | 15.02.2030 | 654.129 | 0,03 |
| 2.950.000 | Australia & New Zealand Banking Group Ltd** | 5,67 % | 03.10.2025 | 2.997.086 | 0,15 |
| 417.000 | Australia & New Zealand Banking Group Ltd* | 6,75 % | 29.12.2049 | 420.058 | 0,02 |
| 600.000 | Avient Corp** | 7,13 % | 01.08.2030 | 624.539 | 0,03 |
| 1.245.000 | Ball Corp* | 2,88 % | 15.08.2030 | 1.069.623 | 0,05 |
| 310.000 | Ball Corp* | 3,13 % | 15.09.2031 | 267.620 | 0,01 |
| 1.000.000 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA* | 6,50 % | 29.12.2049 | 984.043 | 0,05 |
| 800.000 | Banco do Brasil SA* | 6,25 % | 29.12.2049 | 782.584 | 0,04 |
| 2.000.000 | Banco Santander SA* | 5,15 % | 18.08.2025 | 1.989.168 | 0,10 |
| 1.200.000 | Banco Santander SA* | 7,50 % | 29.12.2049 | 1.200.733 | 0,06 |
| 3.320.000 | Bank of America Corp** | 2,97 % | 04.02.2033 | 2.826.074 | 0,14 |
| 213.000 | Bank of America Corp** | 4,30 % | 29.12.2049 | 201.049 | 0,01 |
| 1.690.000 | Bank of America Corp** | 4,38 % | 29.12.2049 | 1.510.397 | 0,07 |
| 1.915.000 | Bank of America Corp** | 4,95 % | 22.07.2028 | 1.915.607 | 0,10 |
| 1.830.000 | Bank of America Corp** | 6,10 % | 29.12.2049 | 1.817.205 | 0,09 |
| 2.130.000 | Bank of Montreal** | 5,30 % | 05.06.2026 | 2.151.934 | 0,11 |
| 210.000 | Bank of New York Mellon Corp** | 3,70 % | 29.12.2049 | 197.497 | 0,01 |
| 3.475.000 | Bank of New York Mellon Corp** | 3,75 % | 29.12.2049 | 3.012.241 | 0,15 |
| 3.360.000 | Bank of Nova Scotia* | 5,35 % | 07.12.2026 | 3.417.686 | 0,17 |
| 1.760.000 | Barclays Plc* | 4,38 % | 29.12.2049 | 1.372.634 | 0,07 |
| 225.000 | Barclays Plc* | 6,13 % | 29.12.2049 | 215.485 | 0,01 |
| 1.730.000 | Barclays Plc* | 6,69 % | 13.09.2034 | 1.850.696 | 0,09 |
| 1.740.000 | Barclays Plc* | 8,00 % | 29.12.2049 | 1.712.007 | 0,08 |
| 1.530.000 | Barclays Plc* | 9,63 % | 29.12.2049 | 1.593.112 | 0,08 |
| 590.000 | Bath & Body Works Inc** | 6,63 % | 01.10.2030 | 603.388 | 0,03 |
| 420.000 | Bath & Body Works Inc* | 6,75 % | 01.07.2036 | 423.230 | 0,02 |
| 1.085.000 | BCPE Empire Holdings Inc** | 7,63 % | 01.05.2027 | 1.047.352 | 0,05 |
| 590.000 | Beacon Roofing Supply Inc** | 4,50 % | 15.11.2026 | 575.361 | 0,03 |
| 460.000 | Benteler International AG** | 10,50 % | 15.05.2028 | 484.944 | 0,02 |
| 815.000 | Berry Global Inc** | 5,63 % | 15.07.2027 | 809.740 | 0,04 |
| 190.000 | Blackstone Mortgage Trust Inc** | 3,75 % | 15.01.2027 | 169.162 | 0,01 |
| 235.000 | BNP Paribas SA* | 4,50 % | 29.12.2049 | 187.654 | 0,01 |

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 26,53 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 270.000 | BNP Paribas SA [*] | 4,63 % | 29.12.2049 | 218.154 | 0,01 |
| 464.000 | BNP Paribas SA [*] | 7,38 % | 29.12.2049 | 465.805 | 0,02 |
| 470.000 | BNP Paribas SA [*] | 9,25 % | 29.12.2049 | 503.756 | 0,03 |
| 890.000 | BNP Paribas SA REG S [*] | 4,63 % | 29.12.2049 | 779.894 | 0,04 |
| 4.040.000 | Boeing Co [*] | 5,81 % | 01.05.2050 | 4.186.456 | 0,21 |
| 4.750.000 | BP Capital Markets Plc [*] | 4,88 % | 29.12.2049 | 4.526.382 | 0,22 |
| 1.115.000 | BPCE SA ^{**} | 3,65 % | 14.01.2037 | 917.696 | 0,05 |
| 1.700.000 | BPCE SA ^{**} | 7,00 % | 19.10.2034 | 1.849.642 | 0,09 |
| 1.695.000 | BPCE SA 144A ^{**} | 7,00 % | 19.10.2034 | 1.844.202 | 0,09 |
| 235.000 | Buckeye Partners LP ^{**} | 5,85 % | 15.11.2043 | 190.740 | 0,01 |
| 325.000 | Builders FirstSource Inc ^{**} | 4,25 % | 01.02.2032 | 293.633 | 0,01 |
| 320.000 | Builders FirstSource Inc ^{**} | 6,38 % | 15.06.2032 | 327.115 | 0,02 |
| 385.000 | C&W Senior Financing DAC ^{**} | 6,88 % | 15.09.2027 | 359.086 | 0,02 |
| 595.000 | Caesars Entertainment Inc ^{**} | 4,63 % | 15.10.2029 | 537.426 | 0,03 |
| 570.000 | Caesars Entertainment Inc ^{**} | 6,25 % | 01.07.2025 | 571.980 | 0,03 |
| 765.000 | Caesars Entertainment Inc ^{**} | 8,13 % | 01.07.2027 | 784.725 | 0,04 |
| 330.000 | Callon Petroleum Co ^{**} | 7,50 % | 15.06.2030 | 333.162 | 0,02 |
| 340.000 | Callon Petroleum Co ^{**} | 8,00 % | 01.08.2028 | 347.614 | 0,02 |
| 325.000 | Calpine Corp ^{**} | 3,75 % | 01.03.2031 | 285.432 | 0,01 |
| 1.142.000 | Calpine Corp ^{**} | 4,63 % | 01.02.2029 | 1.061.827 | 0,05 |
| 1.204.000 | Calpine Corp ^{**} | 5,00 % | 01.02.2031 | 1.105.303 | 0,05 |
| 225.000 | Calpine Corp ^{**} | 5,13 % | 15.03.2028 | 215.866 | 0,01 |
| 1.165.000 | Camelot Return Merger Sub Inc ^{**} | 8,75 % | 01.08.2028 | 1.184.018 | 0,06 |
| 2.850.000 | Capital One Financial Corp ^{**} | 3,95 % | 29.12.2049 | 2.291.226 | 0,11 |
| 865.000 | Capital One Financial Corp ^{**} | 6,38 % | 08.06.2034 | 890.790 | 0,04 |
| 310.000 | Carnival Corp ^{**} | 4,00 % | 01.08.2028 | 288.413 | 0,01 |
| 205.000 | Carnival Corp ^{**} | 7,00 % | 15.08.2029 | 214.173 | 0,01 |
| 895.000 | Carnival Corp ^{**} | 7,63 % | 01.03.2026 | 911.742 | 0,05 |
| 650.000 | Carnival Corp ^{**} | 9,88 % | 01.08.2027 | 682.810 | 0,03 |
| 745.000 | Carnival Holdings Bermuda Ltd ^{**} | 10,38 % | 01.05.2028 | 811.450 | 0,04 |
| 80.000 | Carpenter Technology Corp [*] | 6,38 % | 15.07.2028 | 79.793 | 0,00 |
| 485.000 | Carpenter Technology Corp [*] | 7,63 % | 15.03.2030 | 500.802 | 0,02 |
| 775.000 | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp ^{**} | 4,25 % | 01.02.2031 | 678.323 | 0,03 |
| 480.000 | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp ^{**} | 4,25 % | 15.01.2034 | 390.704 | 0,02 |
| 325.000 | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp ^{**} | 4,50 % | 01.05.2032 | 278.782 | 0,01 |
| 335.000 | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp ^{**} | 4,50 % | 01.06.2033 | 283.892 | 0,01 |
| 375.000 | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp ^{**} | 4,75 % | 01.03.2030 | 343.200 | 0,02 |
| 985.000 | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp ^{**} | 4,75 % | 01.02.2032 | 869.854 | 0,04 |
| 550.000 | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp ^{**} | 5,00 % | 01.02.2028 | 526.659 | 0,03 |
| 503.000 | CDW LLC/CDW Finance Corp ^{**} | 3,57 % | 01.12.2031 | 446.760 | 0,02 |

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 26,53 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 190.000 | Cedar Fair LP** | 5,25 % | 15.07.2029 | 179.466 | 0,01 |
| 625.000 | Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op* | 5,38 % | 15.04.2027 | 612.544 | 0,03 |
| 440.000 | Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op** | 5,50 % | 01.05.2025 | 438.063 | 0,02 |
| 2.804.000 | Charles Schwab Corp** | 4,00 % | 29.12.2049 | 2.218.132 | 0,11 |
| 2.430.000 | Charles Schwab Corp** | 5,85 % | 19.05.2034 | 2.509.662 | 0,12 |
| 725.000 | Chart Industries Inc** | 7,50 % | 01.01.2030 | 758.710 | 0,04 |
| 315.000 | Chart Industries Inc** | 9,50 % | 01.01.2031 | 342.405 | 0,02 |
| 3.710.000 | Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital** | 3,90 % | 01.06.2052 | 2.498.630 | 0,12 |
| 1.990.000 | Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital** | 4,80 % | 01.03.2050 | 1.542.956 | 0,08 |
| 410.000 | CHS/Community Health Systems Inc** | 4,75 % | 15.02.2031 | 322.875 | 0,02 |
| 275.000 | CHS/Community Health Systems Inc** | 5,25 % | 15.05.2030 | 230.375 | 0,01 |
| 300.000 | CHS/Community Health Systems Inc** | 5,63 % | 15.03.2027 | 279.133 | 0,01 |
| 330.000 | CHS/Community Health Systems Inc** | 6,00 % | 15.01.2029 | 297.419 | 0,01 |
| 282.000 | CHS/Community Health Systems Inc** | 8,00 % | 15.12.2027 | 272.475 | 0,01 |
| 970.000 | Churchill Downs Inc** | 6,75 % | 01.05.2031 | 985.700 | 0,05 |
| 1.650.000 | Citigroup Inc** | 4,15 % | 29.12.2049 | 1.420.215 | 0,07 |
| 185.000 | Citigroup Inc** | 4,70 % | 29.12.2049 | 172.528 | 0,01 |
| 152.000 | Citigroup Inc** | 5,00 % | 29.12.2049 | 147.926 | 0,01 |
| 1.550.000 | Citigroup Inc** | 7,38 % | 29.12.2049 | 1.572.624 | 0,08 |
| 393.000 | Citizens Financial Group Inc** | 6,38 % | 29.12.2049 | 359.694 | 0,02 |
| 294.000 | Citizens Financial Group Inc** | 8,69 % | 29.12.2049 | 259.991 | 0,01 |
| 395.000 | Civitas Resources Inc** | 8,38 % | 01.07.2028 | 412.852 | 0,02 |
| 865.000 | Civitas Resources Inc** | 8,63 % | 01.11.2030 | 918.255 | 0,05 |
| 460.000 | Civitas Resources Inc** | 8,75 % | 01.07.2031 | 490.267 | 0,02 |
| 1.395.000 | Comcast Corp** | 2,94 % | 01.11.2056 | 918.339 | 0,05 |
| 400.000 | Commerzbank AG** | 7,00 % | 29.12.2049 | 386.098 | 0,02 |
| 845.000 | CommonSpirit Health** | 4,19 % | 01.10.2049 | 713.262 | 0,04 |
| 3.830.000 | Commonwealth Bank of Australia** | 5,50 % | 12.09.2025 | 3.879.717 | 0,19 |
| 565.000 | CommScope Inc** | 4,75 % | 01.09.2029 | 379.875 | 0,02 |
| 395.000 | CommScope Inc** | 8,25 % | 01.03.2027 | 208.919 | 0,01 |
| 640.000 | CommScope Technologies LLC** | 5,00 % | 15.03.2027 | 266.998 | 0,01 |
| 1.510.000 | Comstock Resources Inc** | 6,75 % | 01.03.2029 | 1.382.816 | 0,07 |
| 2.685.000 | Constellation Brands Inc* | 2,25 % | 01.08.2031 | 2.257.761 | 0,11 |
| 960.000 | Constellation Energy Generation LLC** | 6,50 % | 01.10.2053 | 1.084.555 | 0,05 |
| 1.425.000 | Corebridge Financial Inc** | 4,35 % | 05.04.2042 | 1.210.628 | 0,06 |
| 1.975.000 | Corebridge Financial Inc* | 5,75 % | 15.01.2034 | 2.020.264 | 0,10 |
| 350.000 | Cornerstone Building Brands Inc** | 6,13 % | 15.01.2029 | 287.359 | 0,01 |
| 1.350.000 | Corp Nacional del Cobre de Chile* | 3,15 % | 14.01.2030 | 1.207.140 | 0,06 |
| 655.000 | Coty Inc** | 5,00 % | 15.04.2026 | 645.062 | 0,03 |
| 150.000 | Coty Inc** | 6,50 % | 15.04.2026 | 149.930 | 0,01 |

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 26,53 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 565.000 | Country Garden Holdings Co Ltd** | 4,80 % | 06.08.2030 | 47.567 | 0,00 |
| 1.035.000 | CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC** | 5,50 % | 15.06.2031 | 982.225 | 0,05 |
| 260.000 | CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC** | 7,50 % | 15.12.2033 | 269.760 | 0,01 |
| 1.289.000 | Crown Castle Towers LLC† | 3,66 % | 15.05.2025 | 1.251.190 | 0,06 |
| 1.675.000 | Crown Castle Towers LLC** | 4,24 % | 15.07.2028 | 1.590.649 | 0,08 |
| 590.000 | CSC Holdings LLC** | 4,13 % | 01.12.2030 | 449.533 | 0,02 |
| 695.000 | CSC Holdings LLC** | 4,63 % | 01.12.2030 | 419.342 | 0,02 |
| 400.000 | CSC Holdings LLC** | 5,25 % | 01.06.2024 | 391.856 | 0,02 |
| 1.180.000 | CSC Holdings LLC** | 5,75 % | 15.01.2030 | 735.777 | 0,04 |
| 280.000 | CSC Holdings LLC** | 6,50 % | 01.02.2029 | 247.351 | 0,01 |
| 580.000 | CSC Holdings LLC** | 7,50 % | 01.04.2028 | 434.446 | 0,02 |
| 305.000 | CSC Holdings LLC** | 11,25 % | 15.05.2028 | 314.475 | 0,02 |
| 1.290.000 | CSN Inova Ventures** | 6,75 % | 28.01.2028 | 1.261.376 | 0,06 |
| 4.400.000 | CVS Health Corp* | 5,05 % | 25.03.2048 | 4.119.167 | 0,20 |
| 2.012.000 | Discover Financial Services** | 5,50 % | 29.12.2049 | 1.624.187 | 0,08 |
| 2.480.000 | Discovery Communications LLC** | 4,65 % | 15.05.2050 | 1.995.220 | 0,10 |
| 775.000 | DISH DBS Corp** | 5,13 % | 01.06.2029 | 400.229 | 0,02 |
| 565.000 | Dominion Energy Inc** | 4,35 % | 29.12.2049 | 503.819 | 0,03 |
| 1.000.000 | DT Midstream Inc** | 4,13 % | 15.06.2029 | 921.163 | 0,05 |
| 310.000 | DT Midstream Inc** | 4,38 % | 15.06.2031 | 280.020 | 0,01 |
| 500.000 | Ecopetrol SA** | 5,88 % | 28.05.2045 | 395.507 | 0,02 |
| 1.995.000 | Edison International** | 5,00 % | 29.12.2049 | 1.862.539 | 0,09 |
| 360.000 | Emerald Debt Merger Sub LLC** | 6,63 % | 15.12.2030 | 368.143 | 0,02 |
| 870.000 | Emirates NBD Bank PJSC* | 6,13 % | 29.12.2049 | 866.233 | 0,04 |
| 1.600.000 | Enbridge Inc** | 8,25 % | 15.01.2084 | 1.654.923 | 0,08 |
| 500.000 | Encompass Health Corp* | 4,75 % | 01.02.2030 | 471.413 | 0,02 |
| 535.000 | Energizer Holdings Inc** | 4,38 % | 31.03.2029 | 479.534 | 0,02 |
| 105.000 | Energy Transfer LP** | 7,38 % | 01.02.2031 | 110.414 | 0,01 |
| 370.000 | EQM Midstream Partners LP** | 4,50 % | 15.01.2029 | 349.885 | 0,02 |
| 370.000 | EQM Midstream Partners LP** | 4,75 % | 15.01.2031 | 344.836 | 0,02 |
| 480.000 | EQM Midstream Partners LP* | 5,50 % | 15.07.2028 | 475.901 | 0,02 |
| 400.000 | EQM Midstream Partners LP** | 6,00 % | 01.07.2025 | 400.066 | 0,02 |
| 160.000 | EQM Midstream Partners LP** | 6,50 % | 01.07.2027 | 163.017 | 0,01 |
| 375.000 | EQM Midstream Partners LP** | 7,50 % | 01.06.2027 | 386.633 | 0,02 |
| 290.000 | EQM Midstream Partners LP** | 7,50 % | 01.06.2030 | 312.086 | 0,02 |
| 1.200.000 | EquipmentShare.com Inc** | 9,00 % | 15.05.2028 | 1.236.120 | 0,06 |
| 830.000 | Fifth Third Bancorp** | 1,71 % | 01.11.2027 | 747.435 | 0,04 |
| 2.020.000 | Fifth Third Bancorp** | 4,34 % | 25.04.2033 | 1.879.142 | 0,09 |
| 531.000 | Fifth Third Bancorp** | 8,62 % | 29.12.2049 | 509.498 | 0,03 |
| 250.000 | First Quantum Minerals Ltd** | 6,88 % | 01.03.2026 | 224.111 | 0,01 |

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 26,53 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 230.000 | First Quantum Minerals Ltd** | 7,50 % | 01.04.2025 | 219.513 | 0,01 |
| 400.000 | First Quantum Minerals Ltd** | 8,63 % | 01.06.2031 | 339.500 | 0,02 |
| 470.000 | FMG Resources August 2006 Pty Ltd** | 4,50 % | 15.09.2027 | 452.079 | 0,02 |
| 460.000 | FMG Resources August 2006 Pty Ltd** | 6,13 % | 15.04.2032 | 463.953 | 0,02 |
| 325.000 | Ford Motor Co* | 3,25 % | 12.02.2032 | 270.440 | 0,01 |
| 1.575.000 | Ford Motor Co* | 5,29 % | 08.12.2046 | 1.389.449 | 0,07 |
| 425.000 | Ford Motor Co* | 9,63 % | 22.04.2030 | 501.217 | 0,03 |
| 310.000 | Ford Motor Credit Co LLC* | 2,90 % | 10.02.2029 | 271.747 | 0,01 |
| 365.000 | Ford Motor Credit Co LLC* | 3,38 % | 13.11.2025 | 349.445 | 0,02 |
| 80.000 | Ford Motor Credit Co LLC* | 4,39 % | 08.01.2026 | 77.842 | 0,00 |
| 360.000 | Ford Motor Credit Co LLC* | 5,11 % | 03.05.2029 | 350.406 | 0,02 |
| 185.000 | Ford Motor Credit Co LLC* | 6,80 % | 12.05.2028 | 193.358 | 0,01 |
| 265.000 | Ford Motor Credit Co LLC* | 7,20 % | 10.06.2030 | 282.529 | 0,01 |
| 55.000 | Ford Motor Credit Co LLC* | 7,35 % | 04.11.2027 | 58.038 | 0,00 |
| 1.735.000 | Fox Corp** | 6,50 % | 13.10.2033 | 1.879.134 | 0,09 |
| 370.000 | Frontier Communications Holdings LLC** | 5,00 % | 01.05.2028 | 342.286 | 0,02 |
| 605.000 | Frontier Communications Holdings LLC** | 5,88 % | 15.10.2027 | 584.993 | 0,03 |
| 500.000 | Frontier Communications Holdings LLC** | 5,88 % | 01.11.2029 | 423.064 | 0,02 |
| 330.000 | Frontier Communications Holdings LLC** | 8,75 % | 15.05.2030 | 339.738 | 0,02 |
| 175.000 | FS Luxembourg Sarl** | 10,00 % | 15.12.2025 | 179.588 | 0,01 |
| 300.000 | Garda World Security Corp** | 7,75 % | 15.02.2028 | 310.689 | 0,02 |
| 340.000 | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp* | 6,25 % | 15.05.2026 | 339.919 | 0,02 |
| 380.000 | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp* | 7,75 % | 01.02.2028 | 381.716 | 0,02 |
| 250.000 | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp* | 8,00 % | 15.01.2027 | 254.326 | 0,01 |
| 845.000 | Georgetown University** | 2,94 % | 01.04.2050 | 583.504 | 0,03 |
| 190.000 | GFL Environmental Inc** | 6,75 % | 15.01.2031 | 195.991 | 0,01 |
| 940.000 | Gilead Sciences Inc** | 5,25 % | 15.10.2033 | 980.188 | 0,05 |
| 460.000 | Goldman Sachs Group Inc** | 3,65 % | 29.12.2049 | 409.064 | 0,02 |
| 570.000 | Goldman Sachs Group Inc** | 3,80 % | 29.12.2049 | 508.318 | 0,03 |
| 565.000 | Goldman Sachs Group Inc** | 4,13 % | 29.12.2049 | 503.867 | 0,03 |
| 990.000 | Goldman Sachs Group Inc** | 6,56 % | 24.10.2034 | 1.088.350 | 0,05 |
| 505.000 | Goodyear Tire & Rubber Co** | 5,00 % | 31.05.2026 | 497.541 | 0,02 |
| 1.005.000 | Goodyear Tire & Rubber Co** | 5,00 % | 15.07.2029 | 950.796 | 0,05 |
| 590.000 | Grupo Aval Ltd* | 4,38 % | 04.02.2030 | 501.502 | 0,03 |
| 340.000 | GTCR AP Finance Inc** | 8,00 % | 15.05.2027 | 343.913 | 0,02 |
| 625.000 | GTCR W-2 Merger Sub LLC** | 7,50 % | 15.01.2031 | 660.858 | 0,03 |
| 895.000 | Harvest Midstream I LP** | 7,50 % | 01.09.2028 | 890.677 | 0,04 |
| 550.000 | HB Fuller Co* | 4,25 % | 15.10.2028 | 514.901 | 0,03 |
| 1.480.000 | HCA Inc* | 5,50 % | 01.06.2033 | 1.503.863 | 0,07 |
| 250.000 | Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co** | 8,38 % | 01.11.2033 | 265.246 | 0,01 |

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 26,53 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 630.000 | HSBC Holdings Plc [*] | 4,00 % | 29.12.2049 | 579.617 | 0,03 |
| 560.000 | HSBC Holdings Plc ^{**} | 4,70 % | 29.12.2049 | 457.489 | 0,02 |
| 2.415.000 | HSBC Holdings Plc ^{**} | 6,00 % | 29.12.2049 | 2.312.510 | 0,11 |
| 781.000 | HSBC Holdings Plc ^{**} | 6,38 % | 29.12.2049 | 772.111 | 0,04 |
| 980.000 | HSBC Holdings Plc ^{**} | 8,00 % | 29.12.2049 | 1.011.152 | 0,05 |
| 310.000 | HUB International Ltd ^{**} | 7,00 % | 01.05.2026 | 311.558 | 0,02 |
| 1.765.000 | HUB International Ltd ^{**} | 7,25 % | 15.06.2030 | 1.865.437 | 0,09 |
| 1.355.000 | Hudbay Minerals Inc ^{**} | 4,50 % | 01.04.2026 | 1.313.871 | 0,07 |
| 240.000 | Hudbay Minerals Inc ^{**} | 6,13 % | 01.04.2029 | 235.635 | 0,01 |
| 124.000 | Huntington Bancshares Inc ^{**} | 4,45 % | 29.12.2049 | 109.056 | 0,01 |
| 284.000 | Huntington Bancshares Inc ^{**} | 5,63 % | 29.12.2049 | 257.828 | 0,01 |
| 613.000 | Huntington Bancshares Inc ^{**} | 8,54 % | 29.12.2049 | 575.951 | 0,03 |
| 275.000 | Iliad Holding SASU ^{**} | 6,50 % | 15.10.2026 | 274.659 | 0,01 |
| 215.000 | Iliad Holding SASU ^{**} | 7,00 % | 15.10.2028 | 214.100 | 0,01 |
| 545.000 | Imola Merger Corp ^{**} | 4,75 % | 15.05.2029 | 518.485 | 0,03 |
| 1.370.000 | INEOS Finance Plc [*] | 6,75 % | 15.05.2028 | 1.347.021 | 0,07 |
| 2.358.000 | ING Groep NV ^{**} | 3,88 % | 29.12.2049 | 1.918.822 | 0,10 |
| 1.202.000 | ING Groep NV [*] | 5,75 % | 29.12.2049 | 1.123.111 | 0,06 |
| 859.000 | ING Groep NV [*] | 6,50 % | 29.12.2049 | 838.128 | 0,04 |
| 280.000 | Ingersoll Rand Inc [*] | 5,40 % | 14.08.2028 | 288.716 | 0,01 |
| 425.000 | Ingersoll Rand Inc [*] | 5,70 % | 14.08.2033 | 449.853 | 0,02 |
| 1.325.000 | Intesa Sanpaolo SpA ^{**} | 7,78 % | 20.06.2054 | 1.378.721 | 0,07 |
| 1.865.000 | Intesa Sanpaolo SpA ^{**} | 8,25 % | 21.11.2033 | 2.025.331 | 0,10 |
| 675.000 | Iron Mountain Inc ^{**} | 5,25 % | 15.03.2028 | 656.689 | 0,03 |
| 430.000 | Iron Mountain Inc ^{**} | 5,63 % | 15.07.2032 | 408.077 | 0,02 |
| 295.000 | Iron Mountain Information Management Services Inc ^{**} | 5,00 % | 15.07.2032 | 270.887 | 0,01 |
| 1.645.000 | ITT Holdings LLC ^{**} | 6,50 % | 01.08.2029 | 1.456.919 | 0,07 |
| 560.000 | Jaguar Land Rover Automotive Plc ^{**} | 7,75 % | 15.10.2025 | 566.744 | 0,03 |
| 860.000 | JELD-WEN Inc ^{**} | 4,88 % | 15.12.2027 | 813.603 | 0,04 |
| 2.715.000 | JPMorgan Chase & Co ^{**} | 2,18 % | 01.06.2028 | 2.484.432 | 0,12 |
| 445.000 | JPMorgan Chase & Co ^{**} | 3,65 % | 29.12.2049 | 408.347 | 0,02 |
| 936.000 | JPMorgan Chase & Co ^{**} | 4,60 % | 29.12.2049 | 904.944 | 0,05 |
| 229.000 | JPMorgan Chase & Co ^{**} | 5,00 % | 29.12.2049 | 224.967 | 0,01 |
| 133.000 | JPMorgan Chase & Co ^{**} | 8,22 % | 29.12.2049 | 132.671 | 0,01 |
| 580.000 | KazMunayGas National Co JSC [*] | 5,75 % | 19.04.2047 | 509.876 | 0,03 |
| 270.000 | KB Home [*] | 4,00 % | 15.06.2031 | 242.205 | 0,01 |
| 525.000 | KB Home ^{**} | 7,25 % | 15.07.2030 | 544.091 | 0,03 |
| 1.865.000 | Kinder Morgan Inc [*] | 5,55 % | 01.06.2045 | 1.797.412 | 0,09 |
| 440.000 | Kinetik Holdings LP ^{**} | 5,88 % | 15.06.2030 | 432.244 | 0,02 |
| 915.000 | L3Harris Technologies Inc [*] | 5,40 % | 15.01.2027 | 934.435 | 0,05 |

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 26,53 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 1.830.000 | L3Harris Technologies Inc* | 5,40 % | 31.07.2033 | 1.903.574 | 0,09 |
| 1.460.000 | L3Harris Technologies Inc* | 5,60 % | 31.07.2053 | 1.555.992 | 0,08 |
| 325.000 | Latam Airlines Group SA** | 13,38 % | 15.10.2027 | 363.616 | 0,02 |
| 315.000 | Latam Airlines Group SA** | 13,38 % | 15.10.2029 | 361.038 | 0,02 |
| 445.000 | Leeward Renewable Energy Operations LLC** | 4,25 % | 01.07.2029 | 388.174 | 0,02 |
| 245.000 | Level 3 Financing Inc** | 3,40 % | 01.03.2027 | 234.198 | 0,01 |
| 530.000 | Level 3 Financing Inc** | 3,63 % | 15.01.2029 | 269.283 | 0,01 |
| 265.000 | Level 3 Financing Inc** | 3,75 % | 15.07.2029 | 130.842 | 0,01 |
| 340.000 | Level 3 Financing Inc** | 4,63 % | 15.09.2027 | 205.486 | 0,01 |
| 455.000 | Level 3 Financing Inc** | 10,50 % | 15.05.2030 | 434.695 | 0,02 |
| 485.000 | Liberty Mutual Group Inc** | 4,13 % | 15.12.2051 | 407.330 | 0,02 |
| 750.000 | Light & Wonder International Inc** | 7,25 % | 15.11.2029 | 768.668 | 0,04 |
| 580.000 | Live Nation Entertainment Inc** | 5,63 % | 15.03.2026 | 575.224 | 0,03 |
| 620.000 | Live Nation Entertainment Inc** | 6,50 % | 15.05.2027 | 631.251 | 0,03 |
| 1.895.000 | Lloyds Banking Group Plc* | 4,98 % | 11.08.2033 | 1.847.044 | 0,09 |
| 110.000 | Lloyds Banking Group Plc** | 7,50 % | 29.12.2049 | 107.997 | 0,01 |
| 1.315.000 | Lloyds Banking Group Plc** | 8,00 % | 29.12.2049 | 1.320.915 | 0,07 |
| 964.000 | Lloyds Banking Group Plc Series WI** | 7,50 % | 29.12.2049 | 955.669 | 0,05 |
| 1.835.000 | M&T Bank Corp** | 3,50 % | 29.12.2049 | 1.351.233 | 0,07 |
| 595.000 | Macy's Retail Holdings LLC* | 4,50 % | 15.12.2034 | 482.983 | 0,02 |
| 160.000 | Macy's Retail Holdings LLC* | 5,13 % | 15.01.2042 | 125.028 | 0,01 |
| 540.000 | Macy's Retail Holdings LLC** | 5,88 % | 15.03.2030 | 513.775 | 0,03 |
| 395.000 | Manitowoc Co Inc** | 9,00 % | 01.04.2026 | 397.935 | 0,02 |
| 1.975.000 | Marvell Technology Inc** | 5,95 % | 15.09.2033 | 2.095.819 | 0,10 |
| 830.000 | Masonite International Corp** | 3,50 % | 15.02.2030 | 720.461 | 0,04 |
| 1.150.000 | Mauser Packaging Solutions Holding Co** | 7,88 % | 15.08.2026 | 1.171.368 | 0,06 |
| 625.000 | Mauser Packaging Solutions Holding Co** | 9,25 % | 15.04.2027 | 614.150 | 0,03 |
| 865.000 | McAfee Corp** | 7,38 % | 15.02.2030 | 791.117 | 0,04 |
| 360.000 | McGraw-Hill Education Inc** | 5,75 % | 01.08.2028 | 347.497 | 0,02 |
| 425.000 | McGraw-Hill Education Inc** | 8,00 % | 01.08.2029 | 395.658 | 0,02 |
| 200.000 | Medco Bell Pte Ltd** | 6,38 % | 30.01.2027 | 190.562 | 0,01 |
| 525.000 | Medco Bell Pte Ltd 144A** | 6,38 % | 30.01.2027 | 500.226 | 0,02 |
| 1.460.000 | Medline Borrower LP** | 3,88 % | 01.04.2029 | 1.321.817 | 0,07 |
| 355.000 | Medline Borrower LP** | 5,25 % | 01.10.2029 | 335.090 | 0,02 |
| 915.000 | Melco Resorts Finance Ltd** | 5,63 % | 17.07.2027 | 858.377 | 0,04 |
| 215.000 | Metinvest BV* | 7,65 % | 01.10.2027 | 139.880 | 0,01 |
| 900.000 | Metinvest BV* | 7,75 % | 17.10.2029 | 551.588 | 0,03 |
| 1.815.000 | Metropolitan Life Global Funding I** | 5,00 % | 06.01.2026 | 1.823.151 | 0,09 |
| 2.120.000 | Midwest Gaming Borrower LLC/Midwest Gaming Finance Corp** | 4,88 % | 01.05.2029 | 1.973.943 | 0,10 |
| 1.020.000 | Mizuho Financial Group Inc* | 1,55 % | 09.07.2027 | 932.531 | 0,05 |

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 26,53 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 430.000 | Molina Healthcare Inc** | 3,88 % | 15.11.2030 | 387.014 | 0,02 |
| 790.000 | Molina Healthcare Inc** | 3,88 % | 15.05.2032 | 691.174 | 0,03 |
| 3.070.000 | Molson Coors Beverage Co* | 4,20 % | 15.07.2046 | 2.620.500 | 0,13 |
| 6.775.000 | Morgan Stanley** | 2,48 % | 16.09.2036 | 5.373.230 | 0,27 |
| 2.895.000 | Morgan Stanley** | 5,25 % | 21.04.2034 | 2.896.065 | 0,14 |
| 635.000 | Morgan Stanley** | 5,95 % | 19.01.2038 | 642.448 | 0,03 |
| 875.000 | Mount Sinai Hospital** | 3,74 % | 01.07.2049 | 665.139 | 0,03 |
| 320.000 | MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp* | 5,00 % | 15.10.2027 | 261.677 | 0,01 |
| 365.000 | MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp* | 5,25 % | 01.08.2026 | 326.705 | 0,02 |
| 266.099 | MV24 Capital BV* | 6,75 % | 01.06.2034 | 249.285 | 0,01 |
| 405.000 | Nabors Industries Inc** | 7,38 % | 15.05.2027 | 397.201 | 0,02 |
| 520.000 | Nabors Industries Inc** | 9,13 % | 31.01.2030 | 522.561 | 0,03 |
| 4.640.000 | NatWest Group Plc* | 3,03 % | 28.11.2035 | 3.852.892 | 0,19 |
| 1.580.000 | NatWest Group Plc* | 4,60 % | 29.12.2049 | 1.189.621 | 0,06 |
| 525.000 | NatWest Group Plc* | 6,00 % | 29.12.2049 | 508.887 | 0,03 |
| 470.000 | NCL Corp Ltd** | 5,88 % | 15.02.2027 | 466.236 | 0,02 |
| 555.000 | Neptune Bidco US Inc** | 9,29 % | 15.04.2029 | 517.991 | 0,03 |
| 1.210.000 | New Fortress Energy Inc** | 6,50 % | 30.09.2026 | 1.163.183 | 0,06 |
| 585.000 | New Fortress Energy Inc** | 6,75 % | 15.09.2025 | 580.800 | 0,03 |
| 2.400.000 | New York Life Global Funding** | 0,85 % | 15.01.2026 | 2.219.301 | 0,11 |
| 355.000 | Newfold Digital Holdings Group Inc** | 6,00 % | 15.02.2029 | 268.568 | 0,01 |
| 2.820.000 | NextEra Energy Capital Holdings Inc** | 5,75 % | 01.09.2025 | 2.847.789 | 0,14 |
| 2.245.000 | Nordea Bank Abp* | 1,50 % | 30.09.2026 | 2.047.647 | 0,10 |
| 1.690.000 | Nordea Bank Abp* | 3,75 % | 29.12.2049 | 1.339.236 | 0,07 |
| 540.000 | Northern Oil & Gas Inc** | 8,13 % | 01.03.2028 | 547.312 | 0,03 |
| 635.000 | Northwest Fiber LLC/Northwest Fiber Finance Sub Inc** | 4,75 % | 30.04.2027 | 606.930 | 0,03 |
| 590.000 | Northwest Fiber LLC/Northwest Fiber Finance Sub Inc** | 6,00 % | 15.02.2028 | 546.066 | 0,03 |
| 1.000.000 | Northwestern Mutual Global Funding** | 0,80 % | 14.01.2026 | 925.349 | 0,05 |
| 1.150.000 | Novelis Corp** | 3,88 % | 15.08.2031 | 1.015.087 | 0,05 |
| 515.000 | NRG Energy Inc** | 3,38 % | 15.02.2029 | 455.437 | 0,02 |
| 1.570.000 | NRG Energy Inc** | 3,63 % | 15.02.2031 | 1.350.803 | 0,07 |
| 29.000 | NRG Energy Inc** | 3,88 % | 15.02.2032 | 24.860 | 0,00 |
| 555.000 | NRG Energy Inc** | 10,25 % | 29.12.2049 | 578.355 | 0,03 |
| 1.995.000 | NXP BV/NXP Funding LLC/NXP USA Inc** | 5,00 % | 15.01.2033 | 1.999.403 | 0,10 |
| 660.000 | Olympus Water US Holding Corp** | 4,25 % | 01.10.2028 | 594.633 | 0,03 |
| 540.000 | Olympus Water US Holding Corp** | 9,75 % | 15.11.2028 | 573.827 | 0,03 |
| 825.000 | OneMain Finance Corp** | 6,88 % | 15.03.2025 | 835.795 | 0,04 |
| 565.000 | OneMain Finance Corp** | 7,13 % | 15.03.2026 | 575.997 | 0,03 |
| 1.830.000 | Oracle Corp* | 3,95 % | 25.03.2051 | 1.435.744 | 0,07 |
| 3.570.000 | Oracle Corp* | 4,00 % | 15.11.2047 | 2.834.160 | 0,14 |

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 26,53 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 2.920.000 | Oracle Corp* | 5,55 % | 06.02.2053 | 2.924.210 | 0,14 |
| 1.075.000 | Oztel Holdings SPC Ltd* | 6,63 % | 24.04.2028 | 1.126.462 | 0,06 |
| 50.000 | Pactiv Evergreen Group Issuer Inc/Pactiv Evergreen Group Issuer LLC** | 4,00 % | 15.10.2027 | 46.781 | 0,00 |
| 715.000 | Pactiv Evergreen Group Issuer LLC/Pactiv Evergreen Group Issuer Inc** | 4,38 % | 15.10.2028 | 669.165 | 0,03 |
| 505.000 | Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer** | 5,88 % | 01.10.2028 | 497.120 | 0,02 |
| 595.000 | Performance Food Group Inc** | 5,50 % | 15.10.2027 | 586.910 | 0,03 |
| 460.000 | Periama Holdings LLC* | 5,95 % | 19.04.2026 | 454.360 | 0,02 |
| 725.000 | Permian Resources Operating LLC** | 7,00 % | 15.01.2032 | 748.503 | 0,04 |
| 420.000 | Pertamina Persero PT* | 6,45 % | 30.05.2044 | 460.880 | 0,02 |
| 762.400 | Petroleos de Venezuela SA* | 5,38 % | 12.04.2027 | 85.008 | 0,00 |
| 4.488.565 | Petroleos de Venezuela SA* | 6,00 % | 16.05.2024 | 516.086 | 0,03 |
| 2.302.978 | Petroleos de Venezuela SA** | 6,00 % | 15.11.2026 | 267.721 | 0,01 |
| 810.000 | Petroleos Mexicanos** | 6,35 % | 12.02.2048 | 514.984 | 0,03 |
| 1.935.000 | Petroleos Mexicanos** | 7,69 % | 23.01.2050 | 1.378.561 | 0,07 |
| 550.000 | PetSmart Inc/PetSmart Finance Corp** | 4,75 % | 15.02.2028 | 518.938 | 0,03 |
| 585.000 | PetSmart Inc/PetSmart Finance Corp** | 7,75 % | 15.02.2029 | 569.584 | 0,03 |
| 1.475.000 | Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd* | 5,34 % | 19.05.2063 | 1.490.381 | 0,07 |
| 1.140.000 | Pilgrim's Pride Corp** | 3,50 % | 01.03.2032 | 965.255 | 0,05 |
| 490.000 | Pilgrim's Pride Corp** | 4,25 % | 15.04.2031 | 443.186 | 0,02 |
| 280.000 | Pilgrim's Pride Corp** | 6,25 % | 01.07.2033 | 288.449 | 0,01 |
| 410.000 | Pilgrim's Pride Corp** | 6,88 % | 15.05.2034 | 443.142 | 0,02 |
| 3.783.000 | PNC Financial Services Group Inc** | 3,40 % | 29.12.2049 | 3.035.572 | 0,15 |
| 685.000 | PNC Financial Services Group Inc** | 6,25 % | 29.12.2049 | 640.247 | 0,03 |
| 1.655.000 | PNC Financial Services Group Inc** | 6,88 % | 20.10.2034 | 1.837.976 | 0,09 |
| 600.000 | PPL Capital Funding Inc* | 8,27 % | 30.03.2067 | 560.152 | 0,03 |
| 420.000 | Presidio Holdings Inc** | 4,88 % | 01.02.2027 | 412.076 | 0,02 |
| 425.000 | Presidio Holdings Inc** | 8,25 % | 01.02.2028 | 429.803 | 0,02 |
| 67.000 | Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc** | 5,25 % | 15.04.2024 | 66.627 | 0,00 |
| 355.000 | Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc** | 5,75 % | 15.04.2026 | 357.147 | 0,02 |
| 1.075.000 | Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc** | 6,25 % | 15.01.2028 | 1.069.570 | 0,05 |
| 3.000.000 | Principal Life Global Funding II** | 1,50 % | 17.11.2026 | 2.732.139 | 0,14 |
| 390.000 | Protective Life Global Funding** | 1,30 % | 20.09.2026 | 353.661 | 0,02 |
| 655.000 | Prudential Financial Inc** | 5,13 % | 01.03.2052 | 617.171 | 0,03 |
| 725.000 | Raptor Acquisition Corp/Raptor Co-Issuer LLC** | 4,88 % | 01.11.2026 | 691.718 | 0,03 |
| 805.000 | Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp** | 5,25 % | 15.04.2030 | 601.844 | 0,03 |
| 536.000 | Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp** | 5,75 % | 15.01.2029 | 417.155 | 0,02 |
| 295.000 | RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp** | 4,50 % | 15.02.2029 | 274.602 | 0,01 |
| 620.000 | RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp** | 4,75 % | 15.10.2027 | 599.308 | 0,03 |
| 240.000 | Ritchie Bros Holdings Inc** | 6,75 % | 15.03.2028 | 247.397 | 0,01 |
| 360.000 | Ritchie Bros Holdings Inc** | 7,75 % | 15.03.2031 | 384.250 | 0,02 |

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 26,53 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 625.000 | RLJ Lodging Trust LP** | 3,75 % | 01.07.2026 | 592.659 | 0,03 |
| 365.000 | RLJ Lodging Trust LP** | 4,00 % | 15.09.2029 | 328.373 | 0,02 |
| 430.000 | Rockcliff Energy II LLC** | 5,50 % | 15.10.2029 | 406.975 | 0,02 |
| 1.420.000 | Rogers Communications Inc** | 3,80 % | 15.03.2032 | 1.307.168 | 0,06 |
| 2.845.000 | Royal Bank of Canada** | 4,95 % | 25.04.2025 | 2.847.737 | 0,14 |
| 865.000 | Royal Caribbean Cruises Ltd** | 5,50 % | 31.08.2026 | 857.019 | 0,04 |
| 655.000 | Royal Caribbean Cruises Ltd** | 5,50 % | 01.04.2028 | 647.064 | 0,03 |
| 245.000 | Royal Caribbean Cruises Ltd** | 8,25 % | 15.01.2029 | 260.514 | 0,01 |
| 1.920.000 | RTX Corp* | 6,10 % | 15.03.2034 | 2.084.454 | 0,10 |
| 1.355.000 | SBA Tower Trust** | 2,84 % | 15.01.2025 | 1.308.999 | 0,07 |
| 675.000 | Sealed Air Corp** | 5,00 % | 15.04.2029 | 653.467 | 0,03 |
| 525.000 | SeaWorld Parks & Entertainment Inc** | 5,25 % | 15.08.2029 | 491.393 | 0,02 |
| 260.000 | Sensata Technologies BV** | 4,00 % | 15.04.2029 | 241.911 | 0,01 |
| 495.000 | Sensata Technologies BV** | 5,88 % | 01.09.2030 | 492.318 | 0,02 |
| 785.000 | Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp** | 4,75 % | 15.02.2028 | 738.877 | 0,04 |
| 1.015.000 | Simon Property Group LP* | 6,25 % | 15.01.2034 | 1.104.925 | 0,05 |
| 460.000 | Sirius XM Radio Inc** | 4,00 % | 15.07.2028 | 425.722 | 0,02 |
| 165.000 | Six Flags Entertainment Corp** | 5,50 % | 15.04.2027 | 161.434 | 0,01 |
| 325.000 | Six Flags Entertainment Corp** | 7,25 % | 15.05.2031 | 326.212 | 0,02 |
| 2.000.000 | Skandinaviska Enskilda Banken AB* | 5,13 % | 29.12.2049 | 1.924.178 | 0,10 |
| 590.000 | Solaris Midstream Holdings LLC** | 7,63 % | 01.04.2026 | 598.675 | 0,03 |
| 3.475.000 | Southern Co** | 4,00 % | 15.01.2051 | 3.310.660 | 0,16 |
| 575.000 | SPX FLOW Inc** | 8,75 % | 01.04.2030 | 575.661 | 0,03 |
| 275.000 | SRS Distribution Inc** | 6,13 % | 01.07.2029 | 261.040 | 0,01 |
| 835.000 | Standard Chartered Plc* | 4,30 % | 29.12.2049 | 680.958 | 0,03 |
| 520.000 | Standard Industries Inc** | 3,38 % | 15.01.2031 | 448.115 | 0,02 |
| 740.000 | Standard Industries Inc** | 4,38 % | 15.07.2030 | 680.492 | 0,03 |
| 2.325.000 | State Street Corp** | 1,75 % | 06.02.2026 | 2.235.013 | 0,11 |
| 1.580.000 | State Street Corp** | 2,90 % | 30.03.2026 | 1.535.947 | 0,08 |
| 1.055.000 | Sumitomo Mitsui Financial Group Inc* | 2,63 % | 14.07.2026 | 999.776 | 0,05 |
| 985.000 | Sumitomo Mitsui Financial Group Inc* | 3,01 % | 19.10.2026 | 938.571 | 0,05 |
| 210.000 | Summer BC Bidco B LLC** | 5,50 % | 31.10.2026 | 196.897 | 0,01 |
| 865.000 | Summit Midstream Holdings LLC/Summit Midstream Finance Corp** | 9,00 % | 15.10.2026 | 859.018 | 0,04 |
| 495.000 | Sunnova Energy Corp** | 5,88 % | 01.09.2026 | 421.809 | 0,02 |
| 105.000 | Sunnova Energy Corp** | 11,75 % | 01.10.2028 | 95.646 | 0,00 |
| 1.555.000 | Sysco Corp* | 3,15 % | 14.12.2051 | 1.115.267 | 0,06 |
| 2.073.000 | Sysco Corp* | 6,60 % | 01.04.2050 | 2.436.246 | 0,12 |
| 630.000 | Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp** | 5,50 % | 15.01.2028 | 596.014 | 0,03 |
| 735.000 | Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp** | 6,00 % | 31.12.2030 | 684.305 | 0,03 |
| 340.000 | Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp** | 6,00 % | 01.09.2031 | 314.964 | 0,02 |

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 26,53 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 265.000 | Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp** | 7,50 % | 01.10.2025 | 266.602 | 0,01 |
| 635.000 | Team Health Holdings Inc† | 13,50 % | 30.06.2028 | 622.300 | 0,03 |
| 445.000 | Tenet Healthcare Corp** | 6,13 % | 01.10.2028 | 444.132 | 0,02 |
| 700.000 | Tenet Healthcare Corp** | 6,13 % | 15.06.2030 | 708.636 | 0,04 |
| 310.000 | Tenet Healthcare Corp** | 6,75 % | 15.05.2031 | 317.223 | 0,02 |
| 735.000 | Terex Corp** | 5,00 % | 15.05.2029 | 693.550 | 0,03 |
| 4.665.000 | T-Mobile USA Inc** | 3,40 % | 15.10.2052 | 3.401.664 | 0,17 |
| 1.360.000 | T-Mobile USA Inc** | 4,50 % | 15.04.2050 | 1.202.898 | 0,06 |
| 1.915.000 | Toronto-Dominion Bank** | 0,75 % | 06.01.2026 | 1.769.565 | 0,09 |
| 1.980.000 | Toronto-Dominion Bank** | 3,77 % | 06.06.2025 | 1.949.126 | 0,10 |
| 505.000 | TransDigm Inc* | 4,63 % | 15.01.2029 | 474.448 | 0,02 |
| 1.010.000 | TransDigm Inc* | 5,50 % | 15.11.2027 | 990.368 | 0,05 |
| 305.000 | TransDigm Inc** | 6,25 % | 15.03.2026 | 304.783 | 0,02 |
| 690.000 | TransDigm Inc** | 6,75 % | 15.08.2028 | 706.789 | 0,04 |
| 375.000 | TransDigm Inc* | 7,50 % | 15.03.2027 | 377.134 | 0,02 |
| 590.000 | Trivium Packaging Finance BV* | 5,50 % | 15.08.2026 | 579.471 | 0,03 |
| 500.000 | Trivium Packaging Finance BV* | 8,50 % | 15.08.2027 | 490.814 | 0,02 |
| 950.000 | Tronox Inc** | 4,63 % | 15.03.2029 | 842.169 | 0,04 |
| 190.000 | Truist Financial Corp** | 5,10 % | 29.12.2049 | 173.129 | 0,01 |
| 2.630.000 | Truist Financial Corp** | 5,87 % | 08.06.2034 | 2.684.683 | 0,13 |
| 289.000 | Truist Financial Corp* | 8,75 % | 29.12.2049 | 288.409 | 0,01 |
| 200.000 | UBS Group AG* | 4,38 % | 29.12.2049 | 158.456 | 0,01 |
| 2.330.000 | UBS Group AG* | 4,70 % | 05.08.2027 | 2.297.939 | 0,11 |
| 620.000 | UBS Group AG** | 4,88 % | 29.12.2049 | 559.998 | 0,03 |
| 1.516.000 | UBS Group AG* | 6,88 % | 29.12.2049 | 1.494.208 | 0,07 |
| 1.130.000 | UBS Group AG* | 9,25 % | 29.12.2049 | 1.255.168 | 0,06 |
| 1.000.000 | UBS Group AG REG S** | 9,25 % | 29.12.2049 | 1.081.277 | 0,05 |
| 246.000 | UniCredit SpA** | 8,00 % | 29.12.2049 | 245.244 | 0,01 |
| 1.095.000 | United Airlines Inc** | 4,38 % | 15.04.2026 | 1.067.833 | 0,05 |
| 610.000 | United Rentals North America Inc* | 3,75 % | 15.01.2032 | 540.415 | 0,03 |
| 590.000 | United Rentals North America Inc* | 5,25 % | 15.01.2030 | 581.602 | 0,03 |
| 285.000 | Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC** | 10,50 % | 15.02.2028 | 289.178 | 0,01 |
| 3.350.000 | US Bancorp** | 3,70 % | 29.12.2049 | 2.638.207 | 0,13 |
| 255.000 | US Foods Inc** | 6,88 % | 15.09.2028 | 262.806 | 0,01 |
| 300.000 | US Foods Inc** | 7,25 % | 15.01.2032 | 313.189 | 0,02 |
| 240.000 | Valaris Ltd** | 8,38 % | 30.04.2030 | 246.095 | 0,01 |
| 395.000 | Venture Global LNG Inc** | 8,38 % | 01.06.2031 | 395.390 | 0,02 |
| 385.000 | Venture Global LNG Inc** | 9,50 % | 01.02.2029 | 407.635 | 0,02 |
| 245.000 | Venture Global LNG Inc** | 9,88 % | 01.02.2032 | 255.355 | 0,01 |
| 2.775.000 | Verizon Communications Inc* | 2,99 % | 30.10.2056 | 1.844.355 | 0,09 |

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 26,53 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 690.000 | Virgin Media Secured Finance Plc [*] | 5,50 % | 15.05.2029 | 667.483 | 0,03 |
| 665.000 | VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc ^{**} | 6,38 % | 01.02.2030 | 464.956 | 0,02 |
| 690.000 | VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc ^{**} | 7,88 % | 01.05.2027 | 594.267 | 0,03 |
| 250.000 | VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc ^{**} | 9,50 % | 01.06.2028 | 211.884 | 0,01 |
| 360.000 | Vistra Corp ^{**} | 7,00 % | 29.12.2049 | 355.093 | 0,02 |
| 720.000 | Vistra Operations Co LLC ^{**} | 4,38 % | 01.05.2029 | 672.926 | 0,03 |
| 170.000 | Vistra Operations Co LLC ^{**} | 5,50 % | 01.09.2026 | 167.945 | 0,01 |
| 430.000 | Vistra Operations Co LLC ^{**} | 7,75 % | 15.10.2031 | 446.916 | 0,02 |
| 4.540.000 | Vodafone Group Plc ^{**} | 4,88 % | 19.06.2049 | 4.120.227 | 0,20 |
| 193.000 | Volcan Compania Minera SAA [*] | 4,38 % | 11.02.2026 | 120.116 | 0,01 |
| 4.120.000 | Warnermedia Holdings Inc ^{**} | 5,14 % | 15.03.2052 | 3.538.856 | 0,18 |
| 2.505.000 | Wells Fargo & Co ^{**} | 6,49 % | 23.10.2034 | 2.726.607 | 0,14 |
| 2.565.000 | Westpac Banking Corp ^{**} | 3,02 % | 18.11.2036 | 2.087.831 | 0,10 |
| 2.965.000 | Westpac Banking Corp ^{**} | 5,51 % | 17.11.2025 | 3.014.162 | 0,15 |
| 425.000 | White Cap Parent LLC ^{**} | 8,25 % | 15.03.2026 | 423.582 | 0,02 |
| 475.000 | Windsor Holdings III LLC ^{**} | 8,50 % | 15.06.2030 | 496.982 | 0,02 |
| 430.000 | WR Grace Holdings LLC ^{**} | 5,63 % | 15.08.2029 | 378.876 | 0,02 |
| 795.000 | Wyndham Hotels & Resorts Inc ^{**} | 4,38 % | 15.08.2028 | 743.941 | 0,04 |
| 660.000 | Wynn Macau Ltd [*] | 5,50 % | 15.01.2026 | 644.740 | 0,03 |
| 240.000 | XHR LP ^{**} | 4,88 % | 01.06.2029 | 221.191 | 0,01 |
| 635.000 | XHR LP ^{**} | 6,38 % | 15.08.2025 | 633.955 | 0,03 |
| 1.240.000 | Yum! Brands Inc [*] | 5,38 % | 01.04.2032 | 1.219.643 | 0,06 |
| 1.075.000 | ZF North America Capital Inc ^{**} | 6,88 % | 14.04.2028 | 1.114.661 | 0,06 |
| 375.000 | Ziff Davis Inc ^{**} | 4,63 % | 15.10.2030 | 344.454 | 0,02 |
| US-Dollar insgesamt | | | | 432.669.604 | 21,42 |
| Unternehmensanleihen insgesamt | | | | 535.844.310 | 26,53 |
| Staatsanleihen 8,70 % (31. Dezember 2022: 18,40 %) | | | | | |
| Kolumbianischer Peso | | | | | |
| 911.400.000 | Colombian TES [*] | 6,00 % | 28.04.2028 | 207.688 | 0,01 |
| 5.168.900.000 | Colombian TES [*] | 7,00 % | 30.06.2032 | 1.118.972 | 0,06 |
| 3.618.000.000 | Colombian TES [*] | 7,25 % | 18.10.2034 | 769.456 | 0,04 |
| 341.300.000 | Colombian TES [*] | 13,25 % | 09.02.2033 | 104.639 | 0,00 |
| Kolumbianischer Peso insgesamt | | | | 2.200.755 | 0,11 |
| Ungarischer Forint | | | | | |
| 995.190.000 | Hungary Government Bond [*] | 3,25 % | 22.10.2031 | 2.445.886 | 0,12 |
| 58.290.000 | Hungary Government Bond [*] | 6,75 % | 22.10.2028 | 174.938 | 0,01 |
| Ungarischer Forint insgesamt | | | | 2.620.824 | 0,13 |

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|---|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 8,70 % (31. Dezember 2022: 18,40 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Indonesische Rupiah | | | | | |
| 1.848.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 6,13 % | 15.05.2028 | 118.565 | 0,01 |
| 12.889.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 7,00 % | 15.09.2030 | 855.695 | 0,04 |
| 11.228.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 7,00 % | 15.02.2033 | 756.371 | 0,04 |
| 28.842.000.000 | Indonesia Treasury Bond* | 8,25 % | 15.05.2029 | 2.020.120 | 0,10 |
| Indonesische Rupiah insgesamt | | | | 3.750.751 | 0,19 |
| Mexikanischer Peso | | | | | |
| 84.500.000 | Mexican Bonos* | 7,50 % | 26.05.2033 | 4.555.524 | 0,23 |
| 27.490.000 | Mexican Bonos* | 7,75 % | 29.05.2031 | 1.515.071 | 0,07 |
| 15.230.600 | Mexican Bonos* | 8,50 % | 31.05.2029 | 880.657 | 0,04 |
| Mexikanischer Peso insgesamt | | | | 6.951.252 | 0,34 |
| Peruanischer Sol | | | | | |
| 11.154.000 | Peru Government Bond* | 6,15 % | 12.08.2032 | 2.943.542 | 0,14 |
| 4.237.000 | Peruvian Government International Bond** | 6,90 % | 12.08.2037 | 1.154.779 | 0,06 |
| Peruanischer Sol insgesamt | | | | 4.098.321 | 0,20 |
| Polnischer Zloty | | | | | |
| 7.068.000 | Republic of Poland Government Bond* | 6,00 % | 25.10.2033 | 1.907.558 | 0,09 |
| 3.271.000 | Republic of Poland Government Bond* | 7,50 % | 25.07.2028 | 916.005 | 0,05 |
| Polnischer Zloty insgesamt | | | | 2.823.563 | 0,14 |
| Rumänischer neuer Leu | | | | | |
| 6.455.000 | Romania Government Bond** | 4,85 % | 25.07.2029 | 1.345.988 | 0,07 |
| 10.790.000 | Romania Government Bond* | 8,25 % | 29.09.2032 | 2.710.779 | 0,13 |
| Rumänischer neuer Leu insgesamt | | | | 4.056.767 | 0,20 |
| Südafrikanischer Rand | | | | | |
| 24.429.108 | Republic of South Africa Government Bond* | 8,00 % | 31.01.2030 | 1.231.407 | 0,06 |
| 15.379.799 | Republic of South Africa Government Bond* | 8,25 % | 31.03.2032 | 736.674 | 0,04 |
| 4.946.939 | Republic of South Africa Government Bond* | 8,50 % | 31.01.2037 | 211.958 | 0,01 |
| Südafrikanischer Rand insgesamt | | | | 2.180.039 | 0,11 |
| US-Dollar | | | | | |
| 585.000 | Angolan Government International Bond* | 8,00 % | 26.11.2029 | 521.230 | 0,03 |
| 1.175.000 | Angolan Government International Bond* | 9,38 % | 08.05.2048 | 980.864 | 0,05 |
| 750.000 | Brazilian Government International Bond* | 6,00 % | 20.10.2033 | 751.646 | 0,04 |
| 485.000 | Colombia Government International Bond* | 3,00 % | 30.01.2030 | 410.514 | 0,02 |
| 400.000 | Colombia Government International Bond* | 7,50 % | 02.02.2034 | 423.211 | 0,02 |
| 1.925.000 | Dominican Republic International Bond* | 6,85 % | 27.01.2045 | 1.925.000 | 0,10 |

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|---|---|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 8,70 % (31. Dezember 2022: 18,40 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 645.000 | Ecuador Government International Bond* | 3,50 % | 31.07.2035 | 232.444 | 0,01 |
| 420.000 | Ecuador Government International Bond* | 6,00 % | 31.07.2030 | 196.270 | 0,01 |
| 345.000 | Egypt Government International Bond* | 5,88 % | 16.02.2031 | 226.929 | 0,01 |
| 1.310.000 | Egypt Government International Bond* | 8,50 % | 31.01.2047 | 818.671 | 0,04 |
| 200.000 | El Salvador Government International Bond* | 9,50 % | 15.07.2052 | 167.510 | 0,01 |
| 1.815.000 | Indonesia Government International Bond* | 4,63 % | 15.04.2043 | 1.777.269 | 0,09 |
| 1.700.000 | Ivory Coast Government International Bond* | 6,13 % | 15.06.2033 | 1.568.522 | 0,08 |
| 1.895.000 | Mexico Government International Bond* | 3,50 % | 12.02.2034 | 1.607.949 | 0,08 |
| 1.890.000 | Mexico Government International Bond* | 4,40 % | 12.02.2052 | 1.501.679 | 0,07 |
| 485.000 | Mongolia Government International Bond* | 5,13 % | 07.04.2026 | 471.618 | 0,02 |
| 1.195.000 | Oman Government International Bond* | 7,00 % | 25.01.2051 | 1.293.038 | 0,06 |
| 825.000 | Panama Government International Bond* | 2,25 % | 29.09.2032 | 603.568 | 0,03 |
| 1.100.000 | Panama Government International Bond* | 3,30 % | 19.01.2033 | 871.633 | 0,04 |
| 815.000 | Paraguay Government International Bond* | 4,95 % | 28.04.2031 | 797.681 | 0,04 |
| 635.000 | Qatar Government International Bond* | 4,40 % | 16.04.2050 | 586.581 | 0,03 |
| 785.000 | Republic of South Africa Government International Bond* | 5,65 % | 27.09.2047 | 629.923 | 0,03 |
| 485.000 | Republic of South Africa Government International Bond* | 5,75 % | 30.09.2049 | 388.776 | 0,02 |
| 1.422.000 | Romanian Government International Bond* | 3,00 % | 14.02.2031 | 1.213.734 | 0,06 |
| 580.000 | Romanian Government International Bond* | 3,63 % | 27.03.2032 | 503.150 | 0,02 |
| 630.000 | Romanian Government International Bond* | 4,00 % | 14.02.2051 | 458.513 | 0,02 |
| 1.184.000 | Romanian Government International Bond 144A* | 4,00 % | 14.02.2051 | 861.481 | 0,04 |
| 725.000 | Saudi Government International Bond* | 3,25 % | 17.11.2051 | 516.820 | 0,03 |
| 580.000 | Saudi Government International Bond* | 3,75 % | 21.01.2055 | 442.908 | 0,02 |
| 1.800.000 | Ukraine Government International Bond* | 7,25 % | 15.03.2035 | 437.708 | 0,02 |
| 19.825.000 | United States Treasury Note/Bond* | 0,88 % | 30.06.2026 | 18.335.415 | 0,91 |
| 18.530.000 | United States Treasury Note/Bond* | 1,25 % | 31.03.2028 | 16.619.456 | 0,82 |
| 20.000.000 | United States Treasury Note/Bond* | 1,25 % | 15.08.2031 | 16.555.859 | 0,82 |
| 28.860.000 | United States Treasury Note/Bond* | 1,63 % | 15.05.2031 | 24.763.233 | 1,23 |
| 8.525.000 | United States Treasury Note/Bond* | 2,00 % | 15.02.2050 | 5.611.848 | 0,28 |
| 7.240.000 | United States Treasury Note/Bond* | 2,38 % | 15.05.2051 | 5.168.681 | 0,26 |
| 5.445.000 | United States Treasury Note/Bond* | 3,00 % | 15.11.2044 | 4.508.715 | 0,22 |
| 14.580.000 | United States Treasury Note/Bond* | 3,38 % | 15.05.2033 | 13.996.800 | 0,69 |
| 1.955.000 | United States Treasury Note/Bond* | 3,38 % | 15.05.2044 | 1.724.447 | 0,09 |
| 6.355.000 | United States Treasury Note/Bond* | 3,63 % | 15.05.2053 | 5.876.886 | 0,29 |
| 1.845.000 | United States Treasury Note/Bond* | 3,75 % | 15.11.2043 | 1.725.003 | 0,09 |
| 7.405.000 | United States Treasury Note/Bond* | 4,50 % | 15.05.2038 | 7.872.730 | 0,39 |
| 545.000 | Uruguay Government International Bond* | 5,10 % | 18.06.2050 | 548.591 | 0,03 |
| 3.136.300 | Venezuela Government International Bond* | 8,25 % | 13.10.2024 | 493.104 | 0,02 |
| US-Dollar insgesamt | | | | 146.987.608 | 7,28 |
| Staatsanleihen insgesamt | | | | 175.669.880 | 8,70 |

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|-----------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Mortgage-Backed Securities 45,47 % (31. Dezember 2022: 26,22 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 1.950.239 | Fannie Mae Pool | 2,50 % | 01.08.2051 | 1.659.993 | 0,08 |
| 4.687.144 | Fannie Mae Pool | 2,50 % | 01.09.2051 | 3.991.989 | 0,20 |
| 2.777.956 | Fannie Mae Pool | 2,50 % | 01.10.2051 | 2.369.019 | 0,12 |
| 4.058.174 | Fannie Mae Pool | 2,50 % | 01.11.2051 | 3.458.324 | 0,17 |
| 3.325.391 | Fannie Mae Pool | 2,50 % | 01.12.2051 | 2.829.430 | 0,14 |
| 615.364 | Fannie Mae Pool | 2,50 % | 01.01.2052 | 526.267 | 0,03 |
| 3.095.752 | Fannie Mae Pool | 2,50 % | 01.02.2052 | 2.636.285 | 0,13 |
| 655.138 | Fannie Mae Pool | 2,50 % | 01.03.2052 | 558.483 | 0,03 |
| 4.175.014 | Fannie Mae Pool | 2,50 % | 01.04.2052 | 3.555.234 | 0,18 |
| 2.355.557 | Fannie Mae Pool | 2,50 % | 01.05.2052 | 2.013.763 | 0,10 |
| 1.418.001 | Fannie Mae Pool | 2,50 % | 01.06.2052 | 1.207.235 | 0,06 |
| 45.015.000 | Fannie Mae Pool | 2,50 % | 01.01.2054 | 38.301.435 | 1,90 |
| 2.056.255 | Fannie Mae Pool | 3,00 % | 01.06.2050 | 1.831.115 | 0,09 |
| 1.037.524 | Fannie Mae Pool | 3,00 % | 01.04.2051 | 919.215 | 0,05 |
| 1.473.125 | Fannie Mae Pool | 3,00 % | 01.05.2051 | 1.314.695 | 0,07 |
| 2.182.412 | Fannie Mae Pool | 3,00 % | 01.08.2051 | 1.931.787 | 0,10 |
| 2.353.223 | Fannie Mae Pool | 3,00 % | 01.11.2051 | 2.097.625 | 0,10 |
| 219.903 | Fannie Mae Pool | 3,00 % | 01.12.2051 | 194.587 | 0,01 |
| 923.225 | Fannie Mae Pool | 3,00 % | 01.01.2052 | 817.483 | 0,04 |
| 1.185.521 | Fannie Mae Pool | 3,00 % | 01.02.2052 | 1.049.705 | 0,05 |
| 3.762.124 | Fannie Mae Pool | 3,00 % | 01.03.2052 | 3.329.316 | 0,16 |
| 1.205.309 | Fannie Mae Pool | 3,00 % | 01.04.2052 | 1.067.195 | 0,05 |
| 1.726.867 | Fannie Mae Pool | 3,00 % | 01.05.2052 | 1.528.046 | 0,08 |
| 1.113.878 | Fannie Mae Pool | 3,00 % | 01.06.2052 | 986.125 | 0,05 |
| 610.897 | Fannie Mae Pool | 3,00 % | 01.08.2052 | 540.564 | 0,03 |
| 2.096.855 | Fannie Mae Pool | 3,00 % | 01.03.2053 | 1.855.159 | 0,09 |
| 1.112.973 | Fannie Mae Pool | 3,50 % | 01.05.2051 | 1.029.745 | 0,05 |
| 800.929 | Fannie Mae Pool | 3,50 % | 01.12.2051 | 734.926 | 0,04 |
| 700.781 | Fannie Mae Pool | 3,50 % | 01.02.2052 | 646.456 | 0,03 |
| 2.475.189 | Fannie Mae Pool | 3,50 % | 01.03.2052 | 2.280.353 | 0,11 |
| 3.821.555 | Fannie Mae Pool | 3,50 % | 01.04.2052 | 3.508.033 | 0,17 |
| 2.690.123 | Fannie Mae Pool | 3,50 % | 01.05.2052 | 2.469.325 | 0,12 |
| 4.467.795 | Fannie Mae Pool | 3,50 % | 01.06.2052 | 4.101.271 | 0,20 |
| 4.881.736 | Fannie Mae Pool | 3,50 % | 01.07.2052 | 4.481.250 | 0,22 |
| 2.825.530 | Fannie Mae Pool | 3,50 % | 01.05.2053 | 2.593.507 | 0,13 |
| 15.600.000 | Fannie Mae Pool | 3,50 % | 01.01.2054 | 14.313.000 | 0,71 |
| 1.271.706 | Fannie Mae Pool | 4,00 % | 01.02.2052 | 1.203.916 | 0,06 |
| 1.260.592 | Fannie Mae Pool | 4,00 % | 01.05.2052 | 1.193.524 | 0,06 |
| 4.615.225 | Fannie Mae Pool | 4,00 % | 01.06.2052 | 4.367.292 | 0,22 |
| 8.805.998 | Fannie Mae Pool | 4,00 % | 01.07.2052 | 8.338.306 | 0,41 |

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|-----------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Mortgage-Backed Securities 45,47 % (31. Dezember 2022: 26,22 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 5.792.796 | Fannie Mae Pool | 4,00 % | 01.08.2052 | 5.481.450 | 0,27 |
| 3.377.005 | Fannie Mae Pool | 4,00 % | 01.09.2052 | 3.195.498 | 0,16 |
| 3.746.905 | Fannie Mae Pool | 4,00 % | 01.10.2052 | 3.545.423 | 0,18 |
| 5.971.211 | Fannie Mae Pool | 4,00 % | 01.12.2052 | 5.650.120 | 0,28 |
| 3.961.371 | Fannie Mae Pool | 4,00 % | 01.02.2053 | 3.747.847 | 0,19 |
| 35.210.000 | Fannie Mae Pool | 4,00 % | 01.01.2054 | 33.305.084 | 1,65 |
| 1.074.846 | Fannie Mae Pool | 4,50 % | 01.06.2052 | 1.042.652 | 0,05 |
| 4.025.843 | Fannie Mae Pool | 4,50 % | 01.07.2052 | 3.905.261 | 0,19 |
| 5.590.063 | Fannie Mae Pool | 4,50 % | 01.08.2052 | 5.422.629 | 0,27 |
| 5.460.468 | Fannie Mae Pool | 4,50 % | 01.09.2052 | 5.296.916 | 0,26 |
| 1.554.154 | Fannie Mae Pool | 4,50 % | 01.10.2052 | 1.507.604 | 0,07 |
| 5.433.898 | Fannie Mae Pool | 4,50 % | 01.11.2052 | 5.271.142 | 0,26 |
| 3.950.418 | Fannie Mae Pool | 4,50 % | 01.01.2053 | 3.832.096 | 0,19 |
| 31.475.000 | Fannie Mae Pool | 4,50 % | 01.01.2054 | 30.513.537 | 1,51 |
| 1.926.153 | Fannie Mae Pool | 5,00 % | 01.08.2052 | 1.908.812 | 0,09 |
| 5.748.149 | Fannie Mae Pool | 5,00 % | 01.09.2052 | 5.696.367 | 0,28 |
| 3.139.327 | Fannie Mae Pool | 5,00 % | 01.10.2052 | 3.111.047 | 0,15 |
| 625.487 | Fannie Mae Pool | 5,00 % | 01.11.2052 | 619.277 | 0,03 |
| 1.024.759 | Fannie Mae Pool | 5,00 % | 01.12.2052 | 1.015.059 | 0,05 |
| 3.421.996 | Fannie Mae Pool | 5,00 % | 01.01.2053 | 3.390.747 | 0,17 |
| 2.778.550 | Fannie Mae Pool | 5,00 % | 01.02.2053 | 2.749.929 | 0,14 |
| 3.926.315 | Fannie Mae Pool | 5,00 % | 01.03.2053 | 3.888.637 | 0,19 |
| 4.971.875 | Fannie Mae Pool | 5,00 % | 01.04.2053 | 4.920.662 | 0,24 |
| 1.955.870 | Fannie Mae Pool | 5,00 % | 01.05.2053 | 1.935.723 | 0,10 |
| 4.158.181 | Fannie Mae Pool | 5,00 % | 01.06.2053 | 4.116.292 | 0,20 |
| 1.759.537 | Fannie Mae Pool | 5,00 % | 01.07.2053 | 1.741.138 | 0,09 |
| 1.425.036 | Fannie Mae Pool | 5,00 % | 01.09.2053 | 1.410.134 | 0,07 |
| 13.560.000 | Fannie Mae Pool | 5,00 % | 01.01.2054 | 13.416.984 | 0,66 |
| 1.559.732 | Fannie Mae Pool | 5,50 % | 01.12.2052 | 1.569.739 | 0,08 |
| 4.023.923 | Fannie Mae Pool | 5,50 % | 01.01.2053 | 4.042.984 | 0,20 |
| 1.042.038 | Fannie Mae Pool | 5,50 % | 01.02.2053 | 1.047.012 | 0,05 |
| 3.259.114 | Fannie Mae Pool | 5,50 % | 01.03.2053 | 3.275.885 | 0,16 |
| 3.503.423 | Fannie Mae Pool | 5,50 % | 01.04.2053 | 3.524.185 | 0,17 |
| 5.125.969 | Fannie Mae Pool | 5,50 % | 01.05.2053 | 5.148.694 | 0,25 |
| 1.857.798 | Fannie Mae Pool | 5,50 % | 01.06.2053 | 1.867.896 | 0,09 |
| 3.741.411 | Fannie Mae Pool | 5,50 % | 01.07.2053 | 3.758.762 | 0,19 |
| 4.285.412 | Fannie Mae Pool | 5,50 % | 01.08.2053 | 4.303.741 | 0,21 |
| 822.803 | Fannie Mae Pool | 5,50 % | 01.09.2053 | 826.323 | 0,04 |
| 2.183.038 | Fannie Mae Pool | 5,50 % | 01.10.2053 | 2.192.572 | 0,11 |
| 82.375.000 | Fannie Mae Pool | 5,50 % | 01.01.2054 | 82.735.391 | 4,10 |

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--------------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Mortgage-Backed Securities 45,47 % (31. Dezember 2022: 26,22 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 2.888.943 | Fannie Mae Pool | 6,00 % | 01.01.2053 | 2.936.473 | 0,15 |
| 3.586.028 | Fannie Mae Pool | 6,00 % | 01.02.2053 | 3.646.336 | 0,18 |
| 1.339.801 | Fannie Mae Pool | 6,00 % | 01.04.2053 | 1.363.679 | 0,07 |
| 3.142.034 | Fannie Mae Pool | 6,00 % | 01.06.2053 | 3.191.535 | 0,16 |
| 2.152.272 | Fannie Mae Pool | 6,00 % | 01.07.2053 | 2.185.844 | 0,11 |
| 2.412.015 | Fannie Mae Pool | 6,00 % | 01.08.2053 | 2.449.638 | 0,12 |
| 2.673.155 | Fannie Mae Pool | 6,00 % | 01.10.2053 | 2.722.692 | 0,13 |
| 30.385.000 | Fannie Mae Pool | 6,00 % | 01.01.2054 | 30.855.018 | 1,53 |
| 736.767 | Fannie Mae Pool | 6,50 % | 01.11.2053 | 755.265 | 0,04 |
| 2.808.838 | Fannie Mae Pool (BU8723) | 3,50 % | 01.06.2052 | 2.578.398 | 0,13 |
| 1.347.169 | Fannie Mae Pool (BV2623) | 4,50 % | 01.07.2052 | 1.306.819 | 0,06 |
| 1.422.551 | Fannie Mae Pool (BV2634) | 4,00 % | 01.07.2052 | 1.345.689 | 0,07 |
| 1.141.937 | Fannie Mae Pool (BV7928) | 4,50 % | 01.08.2052 | 1.107.734 | 0,05 |
| 1.667.254 | Fannie Mae Pool (BV7959) | 5,00 % | 01.08.2052 | 1.652.244 | 0,08 |
| 691.647 | Fannie Mae Pool (BV8055) | 4,50 % | 01.09.2052 | 670.930 | 0,03 |
| 2.522.686 | Fannie Mae Pool (BW1192) | 4,50 % | 01.09.2052 | 2.447.126 | 0,12 |
| 4.795.845 | Fannie Mae Pool (BW1502) | 4,50 % | 01.07.2052 | 4.652.200 | 0,23 |
| 2.767.898 | Fannie Mae Pool (BW9903) | 4,50 % | 01.10.2052 | 2.684.994 | 0,13 |
| 1.628.979 | Fannie Mae Pool (BX3198) | 4,00 % | 01.12.2052 | 1.541.343 | 0,08 |
| 2.304.577 | Fannie Mae Pool (BX5065) | 5,50 % | 01.01.2053 | 2.315.627 | 0,11 |
| 2.014.519 | Fannie Mae Pool (BX7768) | 5,00 % | 01.03.2053 | 1.993.919 | 0,10 |
| 2.067.577 | Fannie Mae Pool (BX8626) | 5,50 % | 01.04.2053 | 2.078.816 | 0,10 |
| 571.475 | Fannie Mae Pool (CB2759) | 3,00 % | 01.02.2052 | 505.913 | 0,03 |
| 2.454.751 | Fannie Mae Pool (CB3158) | 2,50 % | 01.03.2052 | 2.101.813 | 0,10 |
| 2.238.031 | Fannie Mae Pool (CB3600) | 3,50 % | 01.05.2052 | 2.061.769 | 0,10 |
| 1.033.754 | Fannie Mae Pool (CB3770) | 3,50 % | 01.06.2052 | 948.966 | 0,05 |
| 843.548 | Fannie Mae Pool (CB3780) | 3,50 % | 01.05.2052 | 774.341 | 0,04 |
| 2.076.876 | Fannie Mae Pool (CB3897) | 3,50 % | 01.06.2052 | 1.906.441 | 0,09 |
| 1.371.115 | Fannie Mae Pool (CB3899) | 3,50 % | 01.06.2052 | 1.263.118 | 0,06 |
| 3.590.361 | Fannie Mae Pool (CB3914) | 4,00 % | 01.06.2052 | 3.397.539 | 0,17 |
| 274.408 | Fannie Mae Pool (CB4386) | 4,50 % | 01.08.2052 | 266.189 | 0,01 |
| 472.826 | Fannie Mae Pool (CB4612) | 4,50 % | 01.09.2052 | 458.664 | 0,02 |
| 3.609.533 | Fannie Mae Pool (CB4613) | 4,50 % | 01.09.2052 | 3.501.420 | 0,17 |
| 2.234.441 | Fannie Mae Pool (CB4861) | 5,00 % | 01.10.2052 | 2.211.546 | 0,11 |
| 754.154 | Fannie Mae Pool (CB5592) | 5,50 % | 01.02.2053 | 757.497 | 0,04 |
| 1.830.780 | Fannie Mae Pool (CB5636) | 5,00 % | 01.02.2053 | 1.816.558 | 0,09 |
| 1.508.242 | Fannie Mae Pool (CB5906) | 5,50 % | 01.03.2053 | 1.516.887 | 0,08 |
| 4.587.926 | Fannie Mae Pool (CB6031) | 5,00 % | 01.04.2053 | 4.541.732 | 0,22 |
| 2.368.995 | Fannie Mae Pool (FS1172) | 3,00 % | 01.11.2051 | 2.098.895 | 0,10 |
| 3.410.166 | Fannie Mae Pool (FS1632) | 2,50 % | 01.08.2051 | 2.910.590 | 0,14 |

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|--------------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Mortgage-Backed Securities 45,47 % (31. Dezember 2022: 26,22 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 319.484 | Fannie Mae Pool (FS1790) | 4,00 % | 01.05.2052 | 302.331 | 0,02 |
| 1.402.097 | Fannie Mae Pool (FS1866) | 3,50 % | 01.05.2052 | 1.289.901 | 0,06 |
| 4.066.199 | Fannie Mae Pool (FS1921) | 2,50 % | 01.02.2052 | 3.465.246 | 0,17 |
| 3.262.455 | Fannie Mae Pool (FS2043) | 2,50 % | 01.04.2052 | 2.790.568 | 0,14 |
| 2.105.488 | Fannie Mae Pool (FS2707) | 3,50 % | 01.04.2052 | 1.932.809 | 0,10 |
| 3.342.673 | Fannie Mae Pool (FS3205) | 2,50 % | 01.04.2052 | 2.858.901 | 0,14 |
| 4.702.604 | Fannie Mae Pool (FS3213) | 3,50 % | 01.07.2052 | 4.316.804 | 0,21 |
| 4.850.777 | Fannie Mae Pool (FS3457) | 4,50 % | 01.11.2052 | 4.705.487 | 0,23 |
| 3.813.601 | Fannie Mae Pool (FS3539) | 3,50 % | 01.07.2052 | 3.500.648 | 0,17 |
| 1.792.929 | Fannie Mae Pool (FS3642) | 5,00 % | 01.11.2052 | 1.776.233 | 0,09 |
| 1.142.434 | Fannie Mae Pool (FS3662) | 5,00 % | 01.01.2053 | 1.136.218 | 0,06 |
| 1.199.859 | Fannie Mae Pool (FS3747) | 5,50 % | 01.12.2052 | 1.207.830 | 0,06 |
| 3.563.062 | Fannie Mae Pool (FS3881) | 5,50 % | 01.02.2053 | 3.584.636 | 0,18 |
| 1.923.213 | Fannie Mae Pool (FS4190) | 5,00 % | 01.04.2053 | 1.905.413 | 0,09 |
| 2.989.690 | Fannie Mae Pool (FS4357) | 5,50 % | 01.04.2053 | 3.009.178 | 0,15 |
| 2.524.827 | Fannie Mae Pool (FS4933) | 6,00 % | 01.06.2053 | 2.568.892 | 0,13 |
| 2.186.842 | Fannie Mae Pool (FS4967) | 4,00 % | 01.10.2052 | 2.069.252 | 0,10 |
| 3.513.176 | Fannie Mae Pool (FS5235) | 5,50 % | 01.07.2053 | 3.529.401 | 0,17 |
| 1.542.990 | Fannie Mae Pool (FS5673) | 4,00 % | 01.02.2053 | 1.460.141 | 0,07 |
| 447.841 | Fannie Mae Pool (MA4466) | 2,50 % | 01.11.2051 | 381.423 | 0,02 |
| 889.986 | Fannie Mae Pool (MA4579) | 3,00 % | 01.04.2052 | 787.518 | 0,04 |
| 1.380.018 | Fannie Mae Pool (MA4600) | 3,50 % | 01.05.2052 | 1.266.804 | 0,06 |
| 672.938 | Fannie Mae Pool (MA4626) | 4,00 % | 01.06.2052 | 636.805 | 0,03 |
| 3.491.390 | Fannie Mae Pool (MA5038) | 5,00 % | 01.06.2053 | 3.455.426 | 0,17 |
| 336.437 | Fannie Mae Pool (MA5166) | 6,00 % | 01.10.2053 | 341.685 | 0,02 |
| 1.780.250 | Freddie Mac Pool | 2,50 % | 01.05.2051 | 1.517.225 | 0,08 |
| 1.757.967 | Freddie Mac Pool | 2,50 % | 01.09.2051 | 1.497.517 | 0,07 |
| 923.849 | Freddie Mac Pool | 2,50 % | 01.10.2051 | 787.142 | 0,04 |
| 878.889 | Freddie Mac Pool | 2,50 % | 01.11.2051 | 748.453 | 0,04 |
| 1.258.663 | Freddie Mac Pool | 2,50 % | 01.12.2051 | 1.071.794 | 0,05 |
| 2.135.542 | Freddie Mac Pool | 2,50 % | 01.01.2052 | 1.818.483 | 0,09 |
| 2.779.340 | Freddie Mac Pool | 2,50 % | 01.02.2052 | 2.366.621 | 0,12 |
| 3.687.195 | Freddie Mac Pool | 2,50 % | 01.03.2052 | 3.139.557 | 0,16 |
| 5.186.485 | Freddie Mac Pool | 2,50 % | 01.04.2052 | 4.422.118 | 0,22 |
| 115.442 | Freddie Mac Pool | 2,50 % | 01.05.2052 | 98.289 | 0,00 |
| 539.308 | Freddie Mac Pool | 2,50 % | 01.07.2052 | 459.278 | 0,02 |
| 1.694.323 | Freddie Mac Pool | 3,00 % | 01.07.2051 | 1.499.191 | 0,07 |
| 357.557 | Freddie Mac Pool | 3,00 % | 01.11.2051 | 317.492 | 0,02 |
| 2.558.548 | Freddie Mac Pool | 3,00 % | 01.12.2051 | 2.265.773 | 0,11 |
| 714.019 | Freddie Mac Pool | 3,00 % | 01.01.2052 | 637.249 | 0,03 |

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|-----------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Mortgage-Backed Securities 45,47 % (31. Dezember 2022: 26,22 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 472.599 | Freddie Mac Pool | 3,00 % | 01.03.2052 | 418.720 | 0,02 |
| 2.276.806 | Freddie Mac Pool | 3,00 % | 01.04.2052 | 2.019.311 | 0,10 |
| 2.767.262 | Freddie Mac Pool | 3,00 % | 01.05.2052 | 2.449.234 | 0,12 |
| 521.157 | Freddie Mac Pool | 3,00 % | 01.06.2052 | 462.221 | 0,02 |
| 236.728 | Freddie Mac Pool | 3,00 % | 01.08.2052 | 209.553 | 0,01 |
| 3.782.369 | Freddie Mac Pool | 3,50 % | 01.04.2052 | 3.470.698 | 0,17 |
| 693.248 | Freddie Mac Pool | 3,50 % | 01.06.2052 | 636.310 | 0,03 |
| 5.098.417 | Freddie Mac Pool | 3,50 % | 01.09.2052 | 4.677.555 | 0,23 |
| 2.029.283 | Freddie Mac Pool | 3,50 % | 01.11.2052 | 1.862.449 | 0,09 |
| 2.126.451 | Freddie Mac Pool | 3,50 % | 01.12.2052 | 1.951.173 | 0,10 |
| 891.984 | Freddie Mac Pool | 3,50 % | 01.05.2053 | 818.725 | 0,04 |
| 2.030.858 | Freddie Mac Pool | 4,00 % | 01.04.2052 | 1.922.744 | 0,10 |
| 1.526.733 | Freddie Mac Pool | 4,00 % | 01.05.2052 | 1.444.708 | 0,07 |
| 1.463.019 | Freddie Mac Pool | 4,00 % | 01.06.2052 | 1.384.453 | 0,07 |
| 3.332.106 | Freddie Mac Pool | 4,00 % | 01.08.2052 | 3.153.078 | 0,16 |
| 5.804.355 | Freddie Mac Pool | 4,00 % | 01.09.2052 | 5.492.193 | 0,27 |
| 3.936.352 | Freddie Mac Pool | 4,00 % | 01.11.2052 | 3.723.253 | 0,18 |
| 5.457.754 | Freddie Mac Pool | 4,00 % | 01.01.2053 | 5.163.666 | 0,26 |
| 1.266.321 | Freddie Mac Pool | 4,00 % | 01.04.2053 | 1.197.953 | 0,06 |
| 4.250.970 | Freddie Mac Pool | 4,00 % | 01.06.2053 | 4.020.840 | 0,20 |
| 1.402.728 | Freddie Mac Pool | 4,50 % | 01.06.2052 | 1.363.649 | 0,07 |
| 1.169.165 | Freddie Mac Pool | 4,50 % | 01.07.2052 | 1.134.146 | 0,06 |
| 3.964.976 | Freddie Mac Pool | 4,50 % | 01.08.2052 | 3.846.217 | 0,19 |
| 1.495.006 | Freddie Mac Pool | 4,50 % | 01.09.2052 | 1.450.227 | 0,07 |
| 4.170.256 | Freddie Mac Pool | 4,50 % | 01.10.2052 | 4.045.348 | 0,20 |
| 2.685.830 | Freddie Mac Pool | 4,50 % | 01.11.2052 | 2.605.384 | 0,13 |
| 398.395 | Freddie Mac Pool | 4,50 % | 01.05.2053 | 386.462 | 0,02 |
| 6.700.245 | Freddie Mac Pool | 5,00 % | 01.10.2052 | 6.631.227 | 0,33 |
| 4.056.323 | Freddie Mac Pool | 5,00 % | 01.11.2052 | 4.019.783 | 0,20 |
| 1.449.946 | Freddie Mac Pool | 5,00 % | 01.12.2052 | 1.435.547 | 0,07 |
| 6.252.352 | Freddie Mac Pool | 5,00 % | 01.01.2053 | 6.190.260 | 0,31 |
| 4.243.539 | Freddie Mac Pool | 5,00 % | 01.02.2053 | 4.199.828 | 0,21 |
| 644.923 | Freddie Mac Pool | 5,00 % | 01.03.2053 | 638.694 | 0,03 |
| 4.902.039 | Freddie Mac Pool | 5,00 % | 01.04.2053 | 4.851.545 | 0,24 |
| 4.304.221 | Freddie Mac Pool | 5,00 % | 01.05.2053 | 4.259.885 | 0,21 |
| 2.576.429 | Freddie Mac Pool | 5,00 % | 01.06.2053 | 2.549.487 | 0,13 |
| 1.134.386 | Freddie Mac Pool | 5,00 % | 01.07.2053 | 1.122.523 | 0,06 |
| 2.408.611 | Freddie Mac Pool | 5,00 % | 01.08.2053 | 2.383.425 | 0,12 |
| 475.000 | Freddie Mac Pool | 5,00 % | 01.01.2054 | 470.033 | 0,02 |
| 2.385.045 | Freddie Mac Pool | 5,50 % | 01.11.2052 | 2.402.477 | 0,12 |

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|---------------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Mortgage-Backed Securities 45,47 % (31. Dezember 2022: 26,22 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 4.518.769 | Freddie Mac Pool | 5,50 % | 01.04.2053 | 4.539.583 | 0,22 |
| 4.592.111 | Freddie Mac Pool | 5,50 % | 01.05.2053 | 4.612.468 | 0,23 |
| 4.836.718 | Freddie Mac Pool | 5,50 % | 01.06.2053 | 4.858.160 | 0,24 |
| 2.180.643 | Freddie Mac Pool | 5,50 % | 01.07.2053 | 2.189.970 | 0,11 |
| 3.539.700 | Freddie Mac Pool | 5,50 % | 01.08.2053 | 3.564.881 | 0,18 |
| 2.542.701 | Freddie Mac Pool | 5,50 % | 01.09.2053 | 2.553.576 | 0,13 |
| 1.453.352 | Freddie Mac Pool | 6,00 % | 01.01.2053 | 1.476.687 | 0,07 |
| 3.655.288 | Freddie Mac Pool | 6,00 % | 01.05.2053 | 3.716.828 | 0,18 |
| 3.547.631 | Freddie Mac Pool | 6,00 % | 01.06.2053 | 3.608.720 | 0,18 |
| 1.081.757 | Freddie Mac Pool | 6,00 % | 01.07.2053 | 1.098.630 | 0,05 |
| 3.835.209 | Freddie Mac Pool | 6,00 % | 01.08.2053 | 3.903.176 | 0,19 |
| 1.835.611 | Freddie Mac Pool | 6,00 % | 01.09.2053 | 1.864.243 | 0,09 |
| 3.456.513 | Freddie Mac Pool | 6,00 % | 01.10.2053 | 3.510.428 | 0,17 |
| 1.748.986 | Freddie Mac Pool | 6,50 % | 01.07.2053 | 1.792.899 | 0,09 |
| 317.637 | Freddie Mac Pool (QC6452) | 2,50 % | 01.09.2051 | 270.491 | 0,01 |
| 1.222.441 | Freddie Mac Pool (QE2363) | 3,50 % | 01.05.2052 | 1.121.287 | 0,06 |
| 2.138.785 | Freddie Mac Pool (QE2482) | 3,50 % | 01.05.2052 | 1.962.570 | 0,10 |
| 2.794.127 | Freddie Mac Pool (QE7028) | 4,50 % | 01.08.2052 | 2.710.437 | 0,13 |
| 787.607 | Freddie Mac Pool (QE8253) | 4,50 % | 01.08.2052 | 764.017 | 0,04 |
| 3.577.777 | Freddie Mac Pool (QF6256) | 5,00 % | 01.01.2053 | 3.544.602 | 0,18 |
| 595.009 | Freddie Mac Pool (QF7085) | 5,50 % | 01.02.2053 | 598.274 | 0,03 |
| 835.660 | Freddie Mac Pool (RA5546) | 3,00 % | 01.07.2051 | 740.801 | 0,04 |
| 2.238.264 | Freddie Mac Pool (RA7642) | 4,50 % | 01.08.2052 | 2.171.224 | 0,11 |
| 1.027.085 | Freddie Mac Pool (RA7784) | 4,50 % | 01.08.2052 | 996.322 | 0,05 |
| 2.419.325 | Freddie Mac Pool (RA7921) | 4,00 % | 01.09.2052 | 2.289.084 | 0,11 |
| 2.026.099 | Freddie Mac Pool (RA8247) | 5,00 % | 01.11.2052 | 2.007.586 | 0,10 |
| 4.038.183 | Freddie Mac Pool (SD1011) | 2,50 % | 01.04.2052 | 3.438.616 | 0,17 |
| 1.534.196 | Freddie Mac Pool (SD1060) | 4,00 % | 01.07.2052 | 1.452.554 | 0,07 |
| 3.749.209 | Freddie Mac Pool (SD1724) | 4,00 % | 01.09.2052 | 3.553.258 | 0,18 |
| 1.172.655 | Freddie Mac Pool (SD1913) | 5,00 % | 01.11.2052 | 1.163.546 | 0,06 |
| 292.300 | Freddie Mac Pool (SD2190) | 4,50 % | 01.10.2052 | 283.545 | 0,01 |
| 1.013.352 | Freddie Mac Pool (SD2334) | 5,00 % | 01.02.2053 | 1.003.264 | 0,05 |
| 1.005.020 | Freddie Mac Pool (SD2611) | 4,00 % | 01.11.2052 | 951.029 | 0,05 |
| 2.149.713 | Freddie Mac Pool (SD2642) | 5,50 % | 01.04.2053 | 2.162.216 | 0,11 |
| 648.118 | Freddie Mac Pool (SD2862) | 6,00 % | 01.05.2053 | 658.697 | 0,03 |
| 1.931.789 | Freddie Mac Pool (SD3010) | 5,50 % | 01.06.2053 | 1.945.485 | 0,10 |
| 801.715 | Freddie Mac Pool (SD3136) | 5,50 % | 01.06.2053 | 807.284 | 0,04 |
| 1.277.559 | Freddie Mac Pool (SD3209) | 2,50 % | 01.04.2052 | 1.088.282 | 0,05 |
| 2.018.689 | Freddie Mac Pool (SD3218) | 5,00 % | 01.05.2053 | 1.997.895 | 0,10 |
| 710.917 | Freddie Mac Pool (SD3371) | 5,50 % | 01.05.2053 | 715.889 | 0,04 |

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|----------------------------------|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| Mortgage-Backed Securities 45,47 % (31. Dezember 2022: 26,22 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 1.621.786 | Freddie Mac Pool (SD3392) | 5,50 % | 01.07.2053 | 1.631.528 | 0,08 |
| 2.298.030 | Freddie Mac Pool (SD8205) | 2,50 % | 01.04.2052 | 1.956.651 | 0,10 |
| 1.127.705 | Freddie Mac Pool (SD8206) | 3,00 % | 01.04.2052 | 998.250 | 0,05 |
| 2.342.945 | Freddie Mac Pool (SD8213) | 3,00 % | 01.05.2052 | 2.072.898 | 0,10 |
| 4.958.967 | Freddie Mac Pool (SD8221) | 3,50 % | 01.06.2052 | 4.550.333 | 0,23 |
| 1.119.103 | Freddie Mac Pool (SD8231) | 4,50 % | 01.07.2052 | 1.085.584 | 0,05 |
| 4.917.023 | Freddie Mac Pool (SD8237) | 4,00 % | 01.08.2052 | 4.652.713 | 0,23 |
| 7.043.119 | Freddie Mac Pool (SD8238) | 4,50 % | 01.08.2052 | 6.832.164 | 0,34 |
| 4.929.259 | Freddie Mac Pool (SD8257) | 4,50 % | 01.10.2052 | 4.781.618 | 0,24 |
| 2.535.980 | Freddie Mac Pool (SD8300) | 5,50 % | 01.02.2053 | 2.549.838 | 0,13 |
| 3.771.105 | Freddie Mac Pool (SD8350) | 6,00 % | 01.08.2053 | 3.829.927 | 0,19 |
| 21.640.000 | Ginnie Mae | 5,00 % | 01.01.2054 | 21.491.252 | 1,06 |
| 8.775.000 | Ginnie Mae | 5,50 % | 01.01.2054 | 8.839.463 | 0,44 |
| 29.315.000 | Ginnie Mae | 6,00 % | 01.01.2054 | 29.810.836 | 1,48 |
| 1.441.669 | Ginnie Mae II Pool | 5,00 % | 20.11.2052 | 1.432.068 | 0,07 |
| 1.107.167 | Ginnie Mae II Pool | 5,00 % | 20.02.2053 | 1.100.601 | 0,05 |
| 1.453.815 | Ginnie Mae II Pool | 5,00 % | 20.03.2053 | 1.444.819 | 0,07 |
| 1.015.786 | Ginnie Mae II Pool | 5,00 % | 20.04.2053 | 1.009.342 | 0,05 |
| 1.943.343 | Ginnie Mae II Pool | 5,00 % | 20.05.2053 | 1.929.517 | 0,10 |
| 2.226.034 | Ginnie Mae II Pool | 5,00 % | 20.07.2053 | 2.210.196 | 0,11 |
| 1.140.499 | Ginnie Mae II Pool | 5,00 % | 20.08.2053 | 1.132.384 | 0,06 |
| 2.117.934 | Ginnie Mae II Pool | 5,50 % | 20.06.2053 | 2.134.019 | 0,11 |
| 4.397.881 | Ginnie Mae II Pool | 5,50 % | 20.07.2053 | 4.431.282 | 0,22 |
| 1.288.392 | Ginnie Mae II Pool | 5,50 % | 20.08.2053 | 1.298.176 | 0,06 |
| 1.191.866 | Ginnie Mae II Pool | 6,00 % | 20.12.2052 | 1.212.638 | 0,06 |
| 740.956 | Ginnie Mae II Pool | 6,00 % | 20.03.2053 | 753.869 | 0,04 |
| 3.876.536 | Ginnie Mae II Pool | 6,00 % | 20.06.2053 | 3.943.489 | 0,20 |
| 6.043.796 | Ginnie Mae II Pool | 6,00 % | 20.07.2053 | 6.148.180 | 0,30 |
| 4.968.670 | Ginnie Mae II Pool | 6,00 % | 20.08.2053 | 5.054.485 | 0,25 |
| 3.180.755 | Ginnie Mae II Pool | 6,00 % | 20.10.2053 | 3.235.690 | 0,16 |
| 2.380.000 | Ginnie Mae II Pool | 6,00 % | 20.12.2053 | 2.421.106 | 0,12 |
| Mortgage-Backed Securities insgesamt ** | | | | 918.338.562 | 45,47 |
| Kommunalanleihen 0,64 % (31. Dezember 2022: 1,57 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 565.000 | Bay Area Toll Authority | 7,04 % | 01.04.2050 | 716.990 | 0,04 |
| 845.000 | California State University | 2,98 % | 01.11.2051 | 603.078 | 0,03 |
| 875.000 | Central Texas Turnpike System | 3,03 % | 15.08.2041 | 658.651 | 0,03 |
| 265.000 | City of Atlantic City NJ | 4,29 % | 01.09.2026 | 260.431 | 0,01 |
| 845.000 | Commonwealth Financing Authority | 3,53 % | 01.06.2042 | 708.283 | 0,04 |

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|--------------------------|---------------------------------------|
| Kommunalanleihen 0,64 % (31. Dezember 2022: 1,57 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 845.000 | County of Clark NV | 3,23 % | 01.07.2044 | 648.130 | 0,03 |
| 705.000 | Dallas Area Rapid Transit | 2,82 % | 01.12.2042 | 540.310 | 0,03 |
| 795.000 | Foothill-Eastern Transportation Corridor Agency | 3,92 % | 15.01.2053 | 638.381 | 0,03 |
| 845.000 | Grand Parkway Transportation Corp | 3,24 % | 01.10.2052 | 636.803 | 0,03 |
| 845.000 | Highland Local School District/Medina County | 3,19 % | 01.12.2049 | 640.675 | 0,03 |
| 845.000 | JobsOhio Beverage System | 2,83 % | 01.01.2038 | 690.169 | 0,03 |
| 460.000 | Los Angeles Community College District | 6,75 % | 01.08.2049 | 575.015 | 0,03 |
| 400.000 | Massachusetts Educational Financing Authority | 4,08 % | 01.07.2027 | 392.191 | 0,02 |
| 725.000 | Michigan Finance Authority | 3,38 % | 01.12.2040 | 594.451 | 0,03 |
| 200.000 | New Jersey Housing & Mortgage Finance Agency | 3,80 % | 01.10.2032 | 192.642 | 0,01 |
| 1.125.000 | New York State Dormitory Authority | 2,69 % | 01.07.2040 | 854.703 | 0,04 |
| 840.000 | Ohio Turnpike & Infrastructure Commission | 3,22 % | 15.02.2048 | 633.790 | 0,03 |
| 845.000 | Ohio University | 2,91 % | 01.12.2043 | 632.266 | 0,03 |
| 705.000 | Regents of the University of California Medical Center Pooled Revenue | 3,01 % | 15.05.2050 | 500.692 | 0,03 |
| 565.000 | State of California | 7,63 % | 01.03.2040 | 710.466 | 0,04 |
| 530.000 | Texas Private Activity Bond Surface Transportation Corp | 3,92 % | 31.12.2049 | 430.866 | 0,02 |
| 845.000 | Utah Transit Authority | 2,77 % | 15.12.2038 | 659.840 | 0,03 |
| Kommunalanleihen insgesamt † | | | | 12.918.823 | 0,64 |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen 0,02 % (31. Dezember 2022: 0,04 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 95.846 | GTT Communications Inc | 12,46 % | 30.12.2027 | 83.446 | 0,00 |
| 78.190 | GTT Communications Inc | 14,45 % | 30.06.2028 | 50.563 | 0,00 |
| 361.611 | Nautilus Power LLC | 10,86 % | 16.11.2026 | 295.810 | 0,02 |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen insgesamt † | | | | 429.819 | 0,02 |
| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | | | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Investmentfonds 3,01 % (31. Dezember 2022: 4,40 %) | | | | | |
| Britisches Pfund | | | | | |
| 163.871 | NB Global Monthly Income Fund Ltd | | | 145.814 | 0,01 |
| Britisches Pfund insgesamt | | | | 145.814 | 0,01 |
| US-Dollar | | | | | |
| 1.208.113 | Neuberger Berman China Bond Fund | | | 11.936.155 | 0,59 |
| 760.691 | Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund | | | 9.158.724 | 0,45 |
| 486.855 | Neuberger Berman European High Yield Fund | | | 6.382.668 | 0,32 |
| 459.982 | Neuberger Berman Global Flexible Credit Income Fund | | | 5.570.377 | 0,28 |
| 654.438 | Neuberger Berman Global High Yield SDG Engagement Fund | | | 8.952.716 | 0,44 |

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|---|--|----------------------|----------------------|
| Investmentfonds 3,01 % (31. Dezember 2022: 4,40 %) (Fortsetzung) | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | |
| 2.000.000 | Neuberger Berman Global Investment Grade Credit Fund | 18.620.000 | 0,92 |
| US-Dollar insgesamt | | 60.620.640 | 3,00 |
| Investmentfonds insgesamt ^a | | 60.766.454 | 3,01 |
| Anlagen insgesamt | | 2.136.969.841 | 105,81 |

Devisenterminkontrakte 1,01 % (31. Dezember 2022: 2,24 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierte Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|-------------------------------|----------------------|
| 12.125.286 BRL | 2.373.472 US\$ | 25.01.2024 | Citibank NA | 1 | 119.205 | 0,01 |
| 154.099 BRL | 31.069 US\$ | 03.04.2024 | Citibank NA | 1 | 388 | 0,00 |
| 15.919.680 BRL | 3.220.000 US\$ | 09.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 55.192 | 0,00 |
| 2.283.491 BRL | 466.918 US\$ | 25.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 2.515 | 0,00 |
| 2.779.597 BRL | 559.545 US\$ | 03.04.2024 | Morgan Stanley | 1 | 7.862 | 0,00 |
| 1.283.559 BRL | 254.847 US\$ | 25.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 9.023 | 0,00 |
| 353.680.999 CLP | 399.481 US\$ | 20.03.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 3.897 | 0,00 |
| 1.062.314.206 COP | 260.620 US\$ | 20.03.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 9.363 | 0,00 |
| 862.968 € | 943.198 US\$ | 04.01.2024 | Barclays Bank Plc | 2 | 10.117 | 0,00 |
| 1.060.596 € | 26.006.283 CZK | 20.03.2024 | Barclays Bank Plc | 1 | 14.041 | 0,00 |
| 309.741 € | 339.704 US\$ | 04.01.2024 | Citibank NA | 2 | 2.465 | 0,00 |
| 35.269 € | 30.421 £ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 200 | 0,00 |
| 736.449 € | 789.705 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 5 | 24.320 | 0,00 |
| 21.300.000 € | 23.143.313 US\$ | 09.01.2024 | Goldman Sachs International | 4 | 391.143 | 0,02 |
| 651.895 € | 714.591 US\$ | 04.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | 5.553 | 0,00 |
| 2.665.307 € | 2.838.755 US\$ | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 3 | 107.309 | 0,01 |
| 45.769 € | 56.645 US\$ | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 4 | 1.706 | 0,00 |
| 1.134.373.800 HUF | 3.220.000 US\$ | 09.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 55.647 | 0,01 |
| 9.761.207.920 IDR | 628.417 US\$ | 20.03.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 4.559 | 0,00 |
| 30.205.046 INR | 361.884 US\$ | 08.02.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 512 | 0,00 |
| 660.557.300 ¥ | 4.625.000 US\$ | 09.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 64.902 | 0,01 |
| 45.868 ¥ | 313 US\$ | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 1 | 13 | 0,00 |
| 1.183.194.027 KRW | 901.409 US\$ | 20.03.2024 | Citibank NA | 2 | 15.241 | 0,00 |
| 6.776.355 MXN | 384.733 US\$ | 20.03.2024 | Citibank NA | 2 | 10.393 | 0,00 |
| 2.962.327 MYR | 643.830 US\$ | 23.01.2024 | Barclays Bank Plc | 1 | 2.933 | 0,00 |
| 1.259.700 MYR | 271.772 US\$ | 23.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | 3.258 | 0,00 |
| 1.652.712 MYR | 350.115 US\$ | 23.01.2024 | Morgan Stanley | 1 | 10.721 | 0,00 |
| 2.754.387 PEN | 720.346 US\$ | 18.01.2024 | Barclays Bank Plc | 1 | 23.198 | 0,00 |
| 794.064 PEN | 206.637 US\$ | 18.01.2024 | Citibank NA | 1 | 7.720 | 0,00 |
| 20.185.857 PHP | 360.294 US\$ | 06.02.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 4.108 | 0,00 |
| 365.125 RON | 73.207 € | 19.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 137 | 0,00 |
| 118.391 RON | 23.736 € | 19.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 45 | 0,00 |

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 1,01 % (31. Dezember 2022: 2,24 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 480.620 SGD | 353.101 US\$ | 22.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 11.594 | 0,00 |
| 32.027.665 THB | 912.845 US\$ | 20.03.2024 | Citibank NA | 2 | 31.804 | 0,00 |
| 19.808.520 TWD | 621.138 US\$ | 12.01.2024 | Citibank NA | 1 | 28.813 | 0,00 |
| 11.748.371 TWD | 369.190 US\$ | 12.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 16.294 | 0,00 |
| 11.632.691 TWD | 371.201 US\$ | 12.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 10.487 | 0,00 |
| 225.318 US\$ | 290.460.716 KRW | 20.03.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 290 | 0,00 |
| 224.111 US\$ | 201.533 € | 05.02.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 1.176 | 0,00 |
| 293.470 US\$ | 5.385.013 ZAR | 20.03.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 1.000 | 0,00 |
| 5.087.026 UYU | 126.417 US\$ | 09.02.2024 | Citibank NA | 1 | 3.536 | 0,00 |
| 5.392.285 UYU | 134.639 US\$ | 27.03.2024 | Citibank NA | 1 | 2.360 | 0,00 |
| 492.131 UYU | 12.151 US\$ | 09.02.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 421 | 0,00 |
| 13.933.693 UYU | 342.309 US\$ | 09.02.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | 13.642 | 0,00 |
| 7.628.085 UYU | 190.645 US\$ | 27.03.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 3.158 | 0,00 |
| 5.378.133 ZAR | 282.547 US\$ | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | 9.549 | 0,00 |
| 12.364.126 ZAR | 651.129 US\$ | 20.03.2024 | Morgan Stanley | 1 | 20.389 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> | | | | | | |
| 4.034.977 AUD | 2.657.774 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | 96.926 | 0,01 |
| 1.111.839 AUD | 710.879 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | 48.180 | 0,00 |
| 214.300.190 AUD | 138.762.406 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 70 | 7.541.455 | 0,37 |
| 298 US\$ | 434 AUD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 2 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen CNY</i> | | | | | | |
| 2.635.142 CNY | 364.477 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 5 | 5.999 | 0,00 |
| 93.204.668 CNY | 12.878.348 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 55 | 225.338 | 0,01 |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 1.332.999 € | 1.436.088 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | 37.325 | 0,00 |
| 20.511.292 € | 21.875.122 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 5 | 796.779 | 0,04 |
| 31.764.177 € | 34.120.129 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 54 | 990.013 | 0,05 |
| 4 US\$ | 3 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 0 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 219.711 £ | 268.276 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | 11.836 | 0,00 |
| 20.308.997 £ | 24.937.709 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 6 | 954.471 | 0,05 |
| 12.897.007 £ | 16.129.765 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 52 | 312.780 | 0,02 |
| 3.748 US\$ | 2.936 £ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 4 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen HKD</i> | | | | | | |
| 17.863.711 HKD | 2.286.721 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 4 | 1.779 | 0,00 |
| 15.404.629 HKD | 1.971.819 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | 1.651 | 0,00 |
| 872.425.056 HKD | 111.744.184 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 35 | 21.259 | 0,00 |
| 367.011 US\$ | 2.863.324 HKD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 10 | 194 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen JPY</i> | | | | | | |
| 791.961.358 ¥ | 5.442.503 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 5 | 188.590 | 0,01 |
| 1.050.510.534 ¥ | 7.127.779 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 6 | 341.678 | 0,02 |

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 1,01 % (31. Dezember 2022: 2,24 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen JPY (Fortsetzung)</i> | | | | | | |
| 20.772.724.677 ¥ | 141.791.589 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 5 | 5.908.956 | 0,29 |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i> | | | | | | |
| 54.316.641 SGD | 39.981.436 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 5 | 1.225.725 | 0,06 |
| 581.470 SGD | 436.917 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | 4.214 | 0,00 |
| 33.759.477 SGD | 25.197.532 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 75 | 413.998 | 0,02 |
| 161 US\$ | 212 SGD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 0 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | 20.251.351 | 1,01 |

Futures-Kontrakte 0,18 % (31. Dezember 2022: 0,22 %)

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens | |
|--|--|--------------------------------|----------------------|-------------|
| (380) | 3-Month Euro EURIBOR Future March 2025 | 13.118 | 0,00 | |
| 12 | Euro-BTP Future March 2024 | 56.204 | 0,00 | |
| 2 | Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2024 | 23.949 | 0,00 | |
| 30 | United Kingdom Long Gilt Future March 2024 | 247.056 | 0,01 | |
| 734 | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2024 | 2.169.467 | 0,11 | |
| 759 | US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2024 | 1.127.581 | 0,06 | |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten [*] | | | 3.637.375 | 0,18 |

Gekaufte Swaptions 0,00 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)

| Nominalwert | Fälligkeit | Beschreibung | Gegenpartei | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|------------|--|---------------------|---------------|----------------------|
| Put-Swaptions | | | | | |
| 20.000.000 EUR | 20.03.2024 | EUR Swaption, upon potential exercise of the option, the Portfolio will enter into swap with the notional value of EUR 20,000,000, in which it will pay a rate of 5.00%, and will receive iTraxx XO.40.V1, strike rate 6.00% | JPMorgan Chase Bank | 15.122 | 0,00 |
| Beizulegender Zeitwert aus gekauften Swaptions insgesamt [∞] (Prämie: 52.385 US\$) | | | | 15.122 | 0,00 |

Credit-Default-Swap-Kontrakten 0,04 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)

| Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei | Referenzverbindlichkeit | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|---|------------|-----------------------------|---|----------------|----------------------|
| USD 15.523.200 | 20.12.2028 | ICE Clear U.S. ¹ | Selling default protection on CDX.NA.HY.41.V2 | 905.422 | 0,04 |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt [*] | | | | 905.422 | 0,04 |

¹Zentral abgewickelter Swap.

Zinsswap-Kontrakte 0,04 % (31. Dezember 2022: 0,03 %)

| Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei | Erhalt/(Zahlung) [#] | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|----------------|------------|--|-------------------------------|-----------------|--------------------|--------------------------------|----------------------|
| CAD 13.647.000 | 17.02.2027 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | Erhalt | 2,67 % | 3M CDOR | 338.271 | 0,02 |

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Zinsswap-Kontrakte 0,04 % (31. Dezember 2022: 0,03 %) (Fortsetzung)

| | Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei | Erhalt/(Zahlung) [#] | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|-------------|------------|--|-------------------------------|-----------------|--------------------|--------------------------------|----------------------|
| SEK | 86.363.000 | 21.11.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 3,15 % | 3M STIBOR | 293.259 | 0,01 |
| AUD | 3.461.661 | 07.12.2053 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 4,47 % | 6M BBSW | 141.936 | 0,01 |
| SEK | 28.899.000 | 11.12.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 2,65 % | 3M STIBOR | 35.148 | 0,00 |
| BRL | 2.262.674 | 02.01.2031 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | (Zahlung) | 11,21 % | 1D BROIS | 26.313 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten [∞] | | | | | | | 834.927 | 0,04 |

[#]Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

¹Zentral abgewickelter Swap.

Total Return Swap-Kontrakte 0,02 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)

| | Nominalwert | Datum der Schließung | Variabler Zinssatz | Referenzunternehmen | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|-------------|----------------------|--------------------|--|--------------------------------|----------------------|
| USD | 38.600.000 | 20.03.2024 | 5,38 ¹ | iBoxx USD Liquid High Yield Index ² | 376.211 | 0,02 |
| USD | 35.080.000 | 20.03.2024 | 5,38 ¹ | iBoxx USD Liquid Investment Grade Index ² | 85.374 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Total Return Swap-Kontrakten [∞] | | | | | 461.585 | 0,02 |

¹ Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist die USD Secured Overnight Financing Rate.

² Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist Goldman Sachs International.

| | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|----------------------|----------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 2.163.075.623 | 107,10 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,27 %) (31. Dezember 2022: (0,54 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 2.784.495.000 CLP | 3.220.000 US\$ | 09.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (31.877) | (0,00) |
| 304.877 € | 264.600 £ | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 1 | (350) | (0,00) |
| 9.031.706 € | 10.000.000 US\$ | 31.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | (11.152) | (0,00) |
| 226.898.908 HUF | 592.121 € | 06.02.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (2.452) | (0,00) |
| 4.759.799 PLN | 1.092.711 € | 20.03.2024 | HSBC Bank Plc | 2 | (1.680) | (0,00) |
| 185.320 US\$ | 171.847 € | 04.01.2024 | Barclays Bank Plc | 1 | (4.518) | (0,00) |
| 877.586 US\$ | 802.035 € | 05.02.2024 | Barclays Bank Plc | 1 | (9.623) | (0,00) |
| 994.341 US\$ | 31.448.970 TWD | 12.01.2024 | Citibank NA | 2 | (37.553) | (0,00) |
| 352.631 US\$ | 480.594 SGD | 22.01.2024 | Citibank NA | 1 | (12.044) | (0,00) |
| 73.766 US\$ | 373.519 BRL | 25.01.2024 | Citibank NA | 1 | (3.021) | (0,00) |
| 228.558 US\$ | 7.900.169 THB | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | (4.455) | (0,00) |
| 65.850 US\$ | 60.697 € | 04.01.2024 | Citibank NA | 1 | (1.201) | (0,00) |
| 173.506 US\$ | 866.035 BRL | 03.04.2024 | Citibank NA | 1 | (3.281) | (0,00) |

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (0,27 %) (31. Dezember 2022: (0,54 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 544.912 US\$ | 2.209.720.488 COP | 01.02.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (21.812) | (0,00) |
| 5.697.250 US\$ | 5.244.119 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 7 | (99.272) | (0,01) |
| 5.320.388 US\$ | 4.235.178 £ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (79.090) | (0,01) |
| 656.541 US\$ | 4.670.139 CNY | 20.03.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (2.851) | (0,00) |
| 335.959 US\$ | 1.284.990 PEN | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (10.922) | (0,00) |
| 348.558 US\$ | 1.652.930 MYR | 23.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (12.326) | (0,00) |
| 377.922 US\$ | 11.712.557 TWD | 12.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (6.387) | (0,00) |
| 1.414.813 US\$ | 1.298.056 € | 04.01.2024 | Goldman Sachs International | 4 | (19.141) | (0,00) |
| 32.000.000 US\$ | 29.743.370 € | 09.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (863.569) | (0,04) |
| 54.079 US\$ | 50.291 € | 04.01.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | (1.477) | (0,00) |
| 196.502 US\$ | 995.791 BRL | 25.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (8.209) | (0,00) |
| 266.855 US\$ | 243.713 € | 04.01.2024 | Morgan Stanley | 1 | (2.373) | (0,00) |
| 574.317 US\$ | 2.150.531 PEN | 18.01.2024 | Morgan Stanley | 1 | (6.216) | (0,00) |
| 7.349.774 US\$ | 5.987.600 £ | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 3 | (283.887) | (0,02) |
| 7.292.459 US\$ | 134.909.994 MXN | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 1 | (653.407) | (0,03) |
| 48.584.642 US\$ | 45.465.190 € | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 4 | (1.669.740) | (0,08) |
| 4.900 US\$ | 52.924 NOK | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (313) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> | | | | | | |
| 222.785 AUD | 152.931 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | (834) | (0,00) |
| 1.391.960 US\$ | 2.191.234 AUD | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (104.006) | (0,01) |
| 1.607.982 US\$ | 2.515.763 AUD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 24 | (109.544) | (0,01) |
| <i>Abgesicherte Klassen CNY</i> | | | | | | |
| 32.140.088 CNY | 4.519.360 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 7 | (770) | (0,00) |
| 81.336 US\$ | 591.954 CNY | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (1.886) | (0,00) |
| 635.472 US\$ | 4.587.361 CNY | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 11 | (9.467) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 49.109 € | 54.570 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (288) | (0,00) |
| 649.690 US\$ | 611.772 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (26.525) | (0,00) |
| 4.822.625 US\$ | 4.500.144 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 55 | (151.555) | (0,01) |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 273.254 £ | 349.523 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (1.149) | (0,00) |
| 2.785.686 £ | 3.551.700 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | (195) | (0,00) |
| 325.910 US\$ | 267.104 £ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (14.624) | (0,00) |
| 134.772 US\$ | 110.678 £ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (6.333) | (0,00) |
| 3.018.266 US\$ | 2.425.311 £ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 23 | (73.791) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen HKD</i> | | | | | | |
| 18.544.116 HKD | 2.376.874 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 3 | (1.207) | (0,00) |
| 73.597.039 HKD | 9.437.911 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 22 | (9.471) | (0,00) |
| 416.655 US\$ | 3.255.015 HKD | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (342) | (0,00) |
| 983.692 US\$ | 7.683.862 HKD | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | (680) | (0,00) |

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (0,27 %) (31. Dezember 2022: (0,54 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen HKD (Fortsetzung)</i> | | | | | | |
| 4.299.957 US\$ | 33.592.199 HKD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 32 | (3.502) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen JPY</i> | | | | | | |
| 694.284 US\$ | 103.324.572 ¥ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (40.386) | (0,00) |
| 1.476.370 US\$ | 218.422.043 ¥ | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | (76.678) | (0,00) |
| 28.568.433 US\$ | 4.148.924.645 ¥ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 14 | (931.713) | (0,05) |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i> | | | | | | |
| 600.524 SGD | 455.770 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | (184) | (0,00) |
| 213.559 US\$ | 291.622 SGD | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (7.679) | (0,00) |
| 2.499.059 US\$ | 3.395.079 SGD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 41 | (76.607) | (0,00) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | (5.513.615) | (0,27) |

Futures-Kontrakte (0,92 %) (31. Dezember 2022: (0,11 %))

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---|---------------------------------|----------------------|
| (52) | 10-Year Mini Japanese Government Bond Future March 2024 | (48.070) | (0,00) |
| (42) | 3 Month SOFR Future March 2025 | (5.775) | (0,00) |
| (70) | Euro-BOBL Future March 2024 | (117.105) | (0,01) |
| (58) | Euro-Bund Future March 2024 | (247.950) | (0,01) |
| (3) | Euro-OAT Future March 2024 | (15.045) | (0,00) |
| (128) | Euro-Schatz Future March 2024 | (91.907) | (0,01) |
| 88 | US Treasury 10-Year Ultra Future March 2024 | (2.750) | (0,00) |
| (731) | US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2024 | (415.296) | (0,02) |
| (503) | US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2024 | (5.057.508) | (0,25) |
| (974) | US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2024 | (12.575.062) | (0,62) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten [*] | | (18.576.468) | (0,92) |

Zinsswap-Kontrakte (0,06 %) (31. Dezember 2022: (0,07 %))

| Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei | Erhalt/(Zahlung) [#] | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|------------|--|-------------------------------|-----------------|--------------------|---------------------------------|----------------------|
| NOK 19.762.621 | 08.12.2053 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 2,75 % | 6M NIBOR | (26.198) | (0,00) |
| SEK 6.206.000 | 11.12.2053 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 2,33 % | 3M STIBOR | (27.686) | (0,00) |
| BRL 3.860.376 | 04.01.2027 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | (Zahlung) | 6,17 % | 1D BROIS | (182.191) | (0,01) |
| BRL 6.266.079 | 02.01.2025 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | (Zahlung) | 6,17 % | 1D BROIS | (231.487) | (0,01) |
| SEK 19.244.000 | 20.11.2053 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 2,80 % | 3M STIBOR | (279.848) | (0,02) |
| CAD 13.647.000 | 17.02.2027 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | (Zahlung) | 2,67 % | 3M CDOR | (338.271) | (0,02) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten [∞] | | | | | | (1.085.681) | (0,06) |

[#]Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

¹Zentral abgewickelter Swap.

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|----------------------|------------------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (25.175.764) | (1,25) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | 2.137.899.859 | 105,85 |
| Sonstige Nettoverbindlichkeiten | (118.296.278) | (5,85) |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | 2.019.603.581 | 100,00 |

| Portfolioanalyse | US\$ | % des Gesamtver- mögens |
|---|----------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 370.662.889 | 15,63 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 1.690.318.366 | 71,26 |
| † Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente | 15.222.132 | 0,64 |
| μ Investmentfonds | 60.766.454 | 2,56 |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | (14.939.093) | (0,63) |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap | 15.869.111 | 0,67 |
| Anlagen insgesamt | 2.137.899.859 | 90,13 |

Sustainable Asia High Yield - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 85,29 % (31. Dezember 2022: 86,13 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 240.000 | Adani Green Energy Ltd* | 4,38 % | 08.09.2024 | 231.889 | 0,81 |
| 600.000 | Adani Green Energy UP Ltd/Prayatna Developers Pvt Ltd/Parampujya Solar Energ* | 6,25 % | 10.12.2024 | 593.638 | 2,08 |
| 500.000 | Agile Group Holdings Ltd** | 6,05 % | 13.10.2025 | 62.500 | 0,22 |
| 400.000 | Axis Bank Ltd* | 4,10 % | 29.12.2049 | 365.433 | 1,28 |
| 400.000 | Bangkok Bank PCL** | 3,73 % | 25.09.2034 | 355.844 | 1,25 |
| 300.000 | Bangkok Bank PCL** | 5,00 % | 29.12.2049 | 287.496 | 1,01 |
| 400.000 | Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT** | 3,75 % | 30.03.2026 | 382.379 | 1,34 |
| 400.000 | Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT* | 4,30 % | 29.12.2049 | 355.413 | 1,24 |
| 250.000 | Bank of East Asia Ltd* | 5,83 % | 29.12.2049 | 218.750 | 0,77 |
| 450.000 | CAS Capital No 1 Ltd* | 4,00 % | 29.12.2049 | 389.070 | 1,36 |
| 200.000 | Champion Path Holdings Ltd** | 4,85 % | 27.01.2028 | 171.931 | 0,60 |
| 200.000 | China Hongqiao Group Ltd* | 6,25 % | 08.06.2024 | 198.770 | 0,70 |
| 700.000 | China SCE Group Holdings Ltd** | 7,00 % | 02.05.2025 | 44.100 | 0,15 |
| 623.875 | Continuum Energy Levanter Pte Ltd** | 4,50 % | 09.02.2027 | 587.140 | 2,06 |
| 500.000 | ENN Clean Energy International Investment Ltd* | 3,38 % | 12.05.2026 | 469.196 | 1,64 |
| 200.000 | ENN Energy Holdings Ltd** | 2,63 % | 17.09.2030 | 171.295 | 0,60 |
| 200.000 | Fortune Star BVI Ltd** | 5,00 % | 18.05.2026 | 146.710 | 0,51 |
| 200.000 | Fortune Star BVI Ltd* | 5,95 % | 19.10.2025 | 166.737 | 0,58 |
| 500.000 | Franshion Brilliant Ltd* | 4,25 % | 23.07.2029 | 325.514 | 1,14 |
| 200.000 | FWD Group Holdings Ltd** | 6,38 % | 29.12.2049 | 177.000 | 0,62 |
| 200.000 | FWD Group Holdings Ltd** | 8,05 % | 29.12.2049 | 182.848 | 0,64 |
| 200.000 | GENM Capital Labuan Ltd* | 3,88 % | 19.04.2031 | 170.820 | 0,60 |
| 729.000 | Globe Telecom Inc* | 4,20 % | 29.12.2049 | 690.203 | 2,42 |
| 300.000 | GLP Pte Ltd* | 4,50 % | 29.12.2049 | 96.181 | 0,34 |
| 370.000 | Greenko Dutch BV** | 3,85 % | 29.03.2026 | 345.367 | 1,21 |
| 1.260.000 | Greenko Power II Ltd* | 4,30 % | 13.12.2028 | 1.139.040 | 3,99 |
| 300.000 | Greenko Solar Mauritius Ltd* | 5,95 % | 29.07.2026 | 290.850 | 1,02 |
| 200.000 | Hanwha Life Insurance Co Ltd** | 3,38 % | 04.02.2032 | 184.496 | 0,65 |
| 400.000 | HDFC Bank Ltd** | 3,70 % | 29.12.2049 | 365.019 | 1,28 |
| 200.000 | Huarong Finance 2017 Co Ltd* | 4,25 % | 07.11.2027 | 182.804 | 0,64 |
| 400.000 | Huarong Finance 2017 Co Ltd* | 4,75 % | 27.04.2027 | 372.380 | 1,30 |
| 700.000 | Huarong Finance 2019 Co Ltd* | 4,50 % | 29.05.2029 | 620.795 | 2,17 |
| 400.000 | Huarong Finance II Co Ltd* | 4,63 % | 03.06.2026 | 380.520 | 1,33 |
| 200.000 | Huarong Finance II Co Ltd* | 5,00 % | 19.11.2025 | 193.330 | 0,68 |
| 200.000 | Huarong Finance II Co Ltd* | 5,50 % | 16.01.2025 | 198.250 | 0,69 |
| 200.000 | Hyundai Capital America** | 5,68 % | 26.06.2028 | 203.999 | 0,71 |
| 563.500 | JSW Hydro Energy Ltd* | 4,13 % | 18.05.2031 | 491.589 | 1,72 |
| 400.000 | JSW Steel Ltd* | 5,05 % | 05.04.2032 | 345.416 | 1,21 |
| 600.000 | Kasikornbank PCL* | 3,34 % | 02.10.2031 | 552.216 | 1,93 |

Sustainable Asia High Yield - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 85,29 % (31. Dezember 2022: 86,13 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 200.000 | Kasikornbank PCL** | 5,28 % | 29.12.2049 | 191.728 | 0,67 |
| 200.000 | Lenovo Group Ltd* | 3,42 % | 02.11.2030 | 176.744 | 0,62 |
| 273.000 | Lenovo Group Ltd* | 5,83 % | 27.01.2028 | 278.621 | 0,98 |
| 200.000 | LG Energy Solution Ltd** | 5,75 % | 25.09.2028 | 206.295 | 0,72 |
| 400.000 | Longfor Group Holdings Ltd** | 3,95 % | 16.09.2029 | 184.403 | 0,65 |
| 500.000 | Medco Bell Pte Ltd** | 6,38 % | 30.01.2027 | 476.406 | 1,67 |
| 300.000 | Medco Oak Tree Pte Ltd** | 7,38 % | 14.05.2026 | 298.248 | 1,04 |
| 300.000 | Meituan* | 3,05 % | 28.10.2030 | 253.434 | 0,89 |
| 900.000 | Melco Resorts Finance Ltd* | 5,38 % | 04.12.2029 | 796.381 | 2,79 |
| 700.000 | Melco Resorts Finance Ltd* | 5,75 % | 21.07.2028 | 648.917 | 2,27 |
| 200.000 | MGM China Holdings Ltd** | 4,75 % | 01.02.2027 | 190.420 | 0,67 |
| 360.000 | MGM China Holdings Ltd* | 5,88 % | 15.05.2026 | 352.178 | 1,23 |
| 600.000 | Network i2i Ltd* | 5,65 % | 29.12.2049 | 594.258 | 2,08 |
| 200.000 | New Metro Global Ltd* | 4,80 % | 15.12.2024 | 79.500 | 0,28 |
| 200.000 | NWD Finance BVI Ltd* | 4,13 % | 29.12.2049 | 109.000 | 0,38 |
| 350.000 | PCPD Capital Ltd* | 5,13 % | 18.06.2026 | 277.060 | 0,97 |
| 400.000 | Periama Holdings LLC* | 5,95 % | 19.04.2026 | 394.712 | 1,38 |
| 200.000 | Philippine National Bank** | 3,28 % | 27.09.2024 | 195.650 | 0,68 |
| 95.000 | ReNew Pvt Ltd** | 5,88 % | 05.03.2027 | 90.944 | 0,32 |
| 600.000 | ReNew Wind Energy AP2/ReNew Power Pvt Ltd other 9 Subsidiaries** | 4,50 % | 14.07.2028 | 533.764 | 1,87 |
| 581.000 | RKPF Overseas 2020 A Ltd** | 5,20 % | 12.01.2026 | 151.490 | 0,53 |
| 600.000 | Sands China Ltd** | 5,65 % | 08.08.2028 | 595.364 | 2,08 |
| 330.000 | Shriram Finance Ltd* | 4,40 % | 13.03.2024 | 327.994 | 1,15 |
| 250.000 | Shui On Development Holding Ltd** | 5,50 % | 03.03.2025 | 143.812 | 0,50 |
| 500.000 | Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd** | 4,75 % | 05.08.2029 | 33.750 | 0,12 |
| 200.000 | SK Hynix Inc* | 6,50 % | 17.01.2033 | 211.311 | 0,74 |
| 1.150.000 | Standard Chartered Plc* | 4,30 % | 29.12.2049 | 937.847 | 3,28 |
| 200.000 | Standard Chartered Plc** | 4,75 % | 29.12.2049 | 163.217 | 0,57 |
| 200.000 | Standard Chartered Plc** | 6,00 % | 29.12.2049 | 196.716 | 0,69 |
| 200.000 | Standard Chartered Plc* | 7,75 % | 29.12.2049 | 204.742 | 0,72 |
| 486.480 | Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd** | 6,75 % | 24.04.2033 | 486.721 | 1,70 |
| 600.000 | Studio City Finance Ltd* | 6,50 % | 15.01.2028 | 557.295 | 1,95 |
| 400.000 | Vedanta Resources Finance II Plc* | 8,95 % | 11.03.2025 | 297.816 | 1,04 |
| 300.000 | Wynn Macau Ltd* | 5,50 % | 01.10.2027 | 283.655 | 0,99 |
| 600.000 | Wynn Macau Ltd* | 5,63 % | 26.08.2028 | 556.245 | 1,95 |
| 310.000 | Yanlord Land HK Co Ltd** | 5,13 % | 20.05.2026 | 180.551 | 0,63 |
| Unternehmensanleihen insgesamt | | | | 24.364.117 | 85,29 |

Sustainable Asia High Yield - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 8,77 % (31. Dezember 2022: 2,63 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 229.000 | Industrial Bank of Korea | 5,38 % | 04.10.2028 | 236.592 | 0,83 |
| 300.000 | Korea Land & Housing Corp | 5,75 % | 06.10.2025 | 303.552 | 1,06 |
| 333.000 | Philippine Government International Bond | 5,00 % | 17.07.2033 | 342.643 | 1,20 |
| 600.000 | Sri Lanka Government International Bond | 5,75 % | 18.04.2023 | 308.625 | 1,08 |
| 200.000 | Sri Lanka Government International Bond | 5,88 % | 25.07.2024 | 105.900 | 0,37 |
| 600.000 | Sri Lanka Government International Bond | 6,13 % | 03.06.2025 | 309.737 | 1,09 |
| 1.150.000 | Sri Lanka Government International Bond | 6,85 % | 03.11.2025 | 595.122 | 2,08 |
| 600.000 | Sri Lanka Government International Bond | 7,55 % | 28.03.2030 | 302.923 | 1,06 |
| Staatsanleihen insgesamt * | | | | 2.505.094 | 8,77 |
| Anlagen insgesamt | | | | 26.869.211 | 94,06 |

Devisenterminkontrakte 0,06 % (31. Dezember 2022: 0,88 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeits- datum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|------------------------|-----------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 4.181 € | 4.531 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | 90 | 0,00 |
| 5.589 € | 6.008 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | 171 | 0,00 |
| 377.678 € | 402.555 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 6 | 14.906 | 0,05 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 447 £ | 555 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | 15 | 0,00 |
| 312 £ | 383 US\$ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 15 | 0,00 |
| 18.180 £ | 22.335 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 2 | 843 | 0,00 |
| 18.545 £ | 22.774 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 3 | 869 | 0,01 |
| 641 £ | 801 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | 17 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ° | | | | | 16.926 | 0,06 |

Futures-Kontrakte 0,09 % (31. Dezember 2022: 0,04 %)

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Netto- vermögens |
|---|--|--------------------------------------|---------------------------|
| 2 | US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2024 | 23.897 | 0,09 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten ± | | 23.897 | 0,09 |

| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|---|-------------------|---------------------------|
| | 26.910.034 | 94,21 |

Sustainable Asia High Yield - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,00 %) (31. Dezember 2022: (0,09 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 2.802 US\$ | 2.635 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (111) | (0,00) |
| 22.754 US\$ | 20.921 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 4 | (370) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 318 US\$ | 261 £ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (15) | (0,00) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | (496) | (0,00) |

Futures-Kontrakte (0,21 %) (31. Dezember 2022: (0,00 %))

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|--|---------------------------------|----------------------|
| (16) | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2024 | (58.271) | (0,21) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten [±] | | (58.271) | (0,21) |

| | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|---|-------------------|----------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (58.767) | (0,21) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | 26.851.267 | 94,00 |
| Sonstiges Nettovermögen | 1.713.684 | 6,00 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | 28.564.951 | 100,00 |

| Portfolioanalyse | US\$ | % des Gesamtvermögens |
|---|-------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 18.881.608 | 65,80 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 7.987.603 | 27,84 |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | (34.374) | (0,12) |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente | 16.430 | 0,06 |
| Anlagen insgesamt | 26.851.267 | 93,58 |

Sustainable Emerging Market Corporate Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 85,35 % (31. Dezember 2022: 88,54 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 268.000 | Abu Dhabi Commercial Bank PJSC* | 4,50 % | 14.09.2027 | 263.727 | 0,27 |
| 450.000 | Abu Dhabi Commercial Bank PJSC* | 5,38 % | 18.07.2028 | 457.133 | 0,47 |
| 330.000 | Abu Dhabi Commercial Bank PJSC* | 5,50 % | 12.01.2029 | 336.825 | 0,34 |
| 205.000 | Abu Dhabi Commercial Bank PJSC** | 8,00 % | 29.12.2049 | 218.170 | 0,22 |
| 300.000 | Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC* | 4,60 % | 02.11.2047 | 276.098 | 0,28 |
| 200.000 | Access Bank Plc* | 6,13 % | 21.09.2026 | 180.530 | 0,18 |
| 245.405 | Acu Petroleo Luxembourg Sarl** | 7,50 % | 13.01.2032 | 233.050 | 0,24 |
| 500.000 | Adani Green Energy UP Ltd/Prayatna Developers Pvt Ltd/Parampujya Solar Energ* | 6,25 % | 10.12.2024 | 494.698 | 0,51 |
| 640.000 | Adib Sukuk Co II Ltd* | 5,70 % | 15.11.2028 | 658.381 | 0,67 |
| 217.000 | Africa Finance Corp* | 2,88 % | 28.04.2028 | 190.417 | 0,19 |
| 303.000 | AIA Group Ltd* | 2,70 % | 29.12.2049 | 276.444 | 0,28 |
| 300.000 | AIA Group Ltd** | 3,60 % | 09.04.2029 | 283.957 | 0,29 |
| 200.000 | AIA Group Ltd** | 4,95 % | 04.04.2033 | 201.530 | 0,21 |
| 352.000 | Akbank TAS** | 6,80 % | 06.02.2026 | 354.145 | 0,36 |
| 320.000 | Aldar Investment Properties Sukuk Ltd* | 4,88 % | 24.05.2033 | 312.389 | 0,32 |
| 362.723 | Alfa Desarrollo SpA** | 4,55 % | 27.09.2051 | 283.533 | 0,29 |
| 450.000 | Alfa SAB de CV** | 6,88 % | 25.03.2044 | 448.999 | 0,46 |
| 264.000 | Almarai Co JSC* | 5,23 % | 25.07.2033 | 267.699 | 0,27 |
| 206.000 | Alsea SAB de CV** | 7,75 % | 14.12.2026 | 210.489 | 0,22 |
| 200.000 | Altice Financing SA* | 5,00 % | 15.01.2028 | 181.338 | 0,19 |
| 200.000 | Altice Financing SA** | 5,75 % | 15.08.2029 | 177.923 | 0,18 |
| 300.000 | America Movil SAB de CV* | 3,63 % | 22.04.2029 | 283.499 | 0,29 |
| 300.000 | America Movil SAB de CV* | 4,70 % | 21.07.2032 | 295.097 | 0,30 |
| 450.000 | Anglo American Capital Plc* | 3,88 % | 16.03.2029 | 422.945 | 0,43 |
| 200.000 | AngloGold Ashanti Holdings Plc* | 3,38 % | 01.11.2028 | 180.174 | 0,18 |
| 260.000 | AngloGold Ashanti Holdings Plc* | 3,75 % | 01.10.2030 | 226.244 | 0,23 |
| 388.000 | Antofagasta Plc* | 5,63 % | 13.05.2032 | 390.487 | 0,40 |
| 200.000 | Axiata Spv5 Labuan Ltd* | 3,06 % | 19.08.2050 | 138.330 | 0,14 |
| 300.000 | Axis Bank Ltd* | 4,10 % | 29.12.2049 | 274.075 | 0,28 |
| 175.000 | Azul Secured Finance LLP** | 10,88 % | 28.05.2030 | 144.827 | 0,15 |
| 400.000 | Banco Davivienda SA** | 6,65 % | 29.12.2049 | 286.500 | 0,29 |
| 400.000 | Banco de Bogota SA* | 6,25 % | 12.05.2026 | 395.254 | 0,40 |
| 300.000 | Banco de Chile** | 2,99 % | 09.12.2031 | 258.478 | 0,26 |
| 200.000 | Banco de Credito del Peru SA** | 3,13 % | 01.07.2030 | 190.413 | 0,19 |
| 500.000 | Banco de Credito e Inversiones SA** | 2,88 % | 14.10.2031 | 424.340 | 0,43 |
| 351.000 | Banco do Brasil SA** | 6,25 % | 18.04.2030 | 365.491 | 0,37 |
| 300.000 | Banco Internacional del Peru SAA Interbank** | 3,25 % | 04.10.2026 | 283.297 | 0,29 |
| 200.000 | Banco Mercantil del Norte SA* | 7,50 % | 29.12.2049 | 188.942 | 0,19 |
| 250.000 | Banco Mercantil del Norte SA* | 7,63 % | 29.12.2049 | 240.533 | 0,25 |
| 241.000 | Banco Santander Chile** | 3,18 % | 26.10.2031 | 208.953 | 0,21 |

Sustainable Emerging Market Corporate Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 85,35 % (31. Dezember 2022: 88,54 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 395.000 | Bancolumbia SA* | 4,63 % | 18.12.2029 | 366.455 | 0,38 |
| 848.000 | Bangkok Bank PCL** | 3,73 % | 25.09.2034 | 754.389 | 0,77 |
| 225.000 | Bangkok Bank PCL** | 5,00 % | 29.12.2049 | 215.622 | 0,22 |
| 250.000 | Bank Hapoalim BM* | 3,26 % | 21.01.2032 | 217.323 | 0,22 |
| 285.000 | Bank Leumi Le-Israel BM** | 3,28 % | 29.01.2031 | 258.338 | 0,26 |
| 333.000 | Bank Muscat SAOG* | 4,75 % | 17.03.2026 | 326.742 | 0,33 |
| 213.000 | Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT** | 3,75 % | 30.03.2026 | 203.794 | 0,21 |
| 200.000 | Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT* | 4,30 % | 29.12.2049 | 177.706 | 0,18 |
| 400.000 | BBVA Bancomer SA** | 5,13 % | 18.01.2033 | 362.716 | 0,37 |
| 249.000 | Bidvest Group UK Plc* | 3,63 % | 23.09.2026 | 231.570 | 0,24 |
| 700.000 | BOC Aviation Ltd* | 3,00 % | 11.09.2029 | 630.038 | 0,64 |
| 405.000 | BOC Aviation Ltd** | 3,50 % | 18.09.2027 | 385.460 | 0,39 |
| 240.000 | BOC Aviation Ltd* | 4,50 % | 23.05.2028 | 235.620 | 0,24 |
| 200.000 | BOC Aviation USA Corp** | 4,88 % | 03.05.2033 | 195.947 | 0,20 |
| 200.000 | Borr IHC Ltd/Borr Finance LLC** | 10,00 % | 15.11.2028 | 209.000 | 0,21 |
| 200.000 | Braskem Idesa SAPI** | 6,99 % | 20.02.2032 | 113.162 | 0,12 |
| 400.000 | BRF SA** | 4,88 % | 24.01.2030 | 352.161 | 0,36 |
| 385.000 | BSF Finance* | 5,50 % | 23.11.2027 | 391.256 | 0,40 |
| 400.000 | Canacol Energy Ltd** | 5,75 % | 24.11.2028 | 292.095 | 0,30 |
| 200.000 | CAS Capital No 1 Ltd* | 4,00 % | 29.12.2049 | 172.920 | 0,18 |
| 321.000 | CBQ Finance Ltd* | 2,00 % | 12.05.2026 | 296.302 | 0,30 |
| 200.000 | CDBL Funding 2* | 2,00 % | 04.03.2026 | 188.096 | 0,19 |
| 400.000 | Cemex SAB de CV** | 5,13 % | 29.12.2049 | 379.672 | 0,39 |
| 534.000 | Cemex SAB de CV** | 9,13 % | 29.12.2049 | 569.378 | 0,58 |
| 300.000 | Cencosud SA* | 4,38 % | 17.07.2027 | 289.640 | 0,30 |
| 300.000 | Central American Bottling Corp/CBC Bottling Holdco SL/Beliv Holdco SL** | 5,25 % | 27.04.2029 | 282.042 | 0,29 |
| 200.000 | Champion Path Holdings Ltd** | 4,85 % | 27.01.2028 | 172.315 | 0,18 |
| 200.000 | China Cinda Finance 2017 I Ltd* | 4,75 % | 08.02.2028 | 195.723 | 0,20 |
| 200.000 | China Development Bank Financial Leasing Co Ltd* | 2,88 % | 28.09.2030 | 189.461 | 0,19 |
| 350.000 | China Hongqiao Group Ltd* | 6,25 % | 08.06.2024 | 347.560 | 0,36 |
| 200.000 | China Overseas Finance Cayman VI Ltd** | 6,45 % | 11.06.2034 | 207.303 | 0,21 |
| 200.000 | China SCE Group Holdings Ltd** | 7,00 % | 02.05.2025 | 12.600 | 0,01 |
| 300.000 | Cibanco SA Ibm/PLA Administradora Industrial S de RL de CV** | 4,96 % | 18.07.2029 | 286.559 | 0,29 |
| 200.000 | CK Hutchison International 21 Ltd* | 2,50 % | 15.04.2031 | 171.577 | 0,18 |
| 400.000 | CK Hutchison International 23 Ltd* | 4,88 % | 21.04.2033 | 401.617 | 0,41 |
| 320.000 | CMB International Leasing Management Ltd* | 1,88 % | 12.08.2025 | 303.577 | 0,31 |
| 390.000 | Commercial Bank of Dubai PSC* | 5,32 % | 14.06.2028 | 389.727 | 0,40 |
| 200.000 | Commercial Bank PSQC* | 4,50 % | 29.12.2049 | 183.482 | 0,19 |

Sustainable Emerging Market Corporate Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 85,35 % (31. Dezember 2022: 88,54 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 200.000 | Compania Cervecerias Unidas SA** | 3,35 % | 19.01.2032 | 172.373 | 0,18 |
| 200.000 | Compania de Minas Buenaventura SAA** | 5,50 % | 23.07.2026 | 191.108 | 0,20 |
| 267.375 | Continuum Energy Levanter Pte Ltd** | 4,50 % | 09.02.2027 | 251.631 | 0,26 |
| 239.000 | CSN Inova Ventures** | 6,75 % | 28.01.2028 | 233.697 | 0,24 |
| 400.000 | CSN Resources SA** | 4,63 % | 10.06.2031 | 327.541 | 0,34 |
| 555.000 | CT Trust** | 5,13 % | 03.02.2032 | 485.657 | 0,50 |
| 300.000 | DBS Group Holdings Ltd** | 1,82 % | 10.03.2031 | 278.277 | 0,28 |
| 323.000 | DIB Sukuk Ltd† | 1,96 % | 22.06.2026 | 300.554 | 0,31 |
| 322.000 | DIB Sukuk Ltd† | 4,80 % | 16.08.2028 | 319.753 | 0,33 |
| 308.000 | DIB Sukuk Ltd† | 5,49 % | 30.11.2027 | 314.202 | 0,32 |
| 250.000 | DIB Tier 1 Sukuk 3 Ltd† | 6,25 % | 29.12.2049 | 249.405 | 0,26 |
| 273.000 | Eastern & Southern African Trade & Development Bank† | 4,13 % | 30.06.2028 | 236.554 | 0,24 |
| 263.000 | Ecopetrol SA** | 4,63 % | 02.11.2031 | 223.393 | 0,23 |
| 480.000 | Ecopetrol SA** | 5,88 % | 28.05.2045 | 379.679 | 0,39 |
| 200.000 | Ecopetrol SA** | 6,88 % | 29.04.2030 | 198.437 | 0,20 |
| 300.000 | Ecopetrol SA** | 7,38 % | 18.09.2043 | 286.688 | 0,29 |
| 687.000 | Ecopetrol SA† | 8,88 % | 13.01.2033 | 747.220 | 0,76 |
| 300.000 | EIG Pearl Holdings Sarl† | 3,55 % | 31.08.2036 | 262.013 | 0,27 |
| 224.000 | EIG Pearl Holdings Sarl† | 4,39 % | 30.11.2046 | 180.410 | 0,18 |
| 292.000 | Emaar Sukuk Ltd† | 3,88 % | 17.09.2029 | 269.177 | 0,28 |
| 200.000 | Emirates NBD Bank PJSC** | 4,25 % | 29.12.2049 | 180.500 | 0,18 |
| 329.000 | Emirates NBD Bank PJSC† | 5,63 % | 21.10.2027 | 334.795 | 0,34 |
| 200.000 | Emirates NBD Bank PJSC† | 5,88 % | 11.10.2028 | 207.008 | 0,21 |
| 300.000 | Emirates NBD Bank PJSC† | 6,13 % | 29.12.2049 | 298.701 | 0,31 |
| 205.000 | Enel Chile SA† | 4,88 % | 12.06.2028 | 202.726 | 0,21 |
| 200.000 | Energian Israel Finance Ltd** | 4,88 % | 30.03.2026 | 184.850 | 0,19 |
| 100.000 | Energian Israel Finance Ltd** | 5,88 % | 30.03.2031 | 84.672 | 0,09 |
| 480.000 | ENN Clean Energy International Investment Ltd† | 3,38 % | 12.05.2026 | 450.428 | 0,46 |
| 500.000 | ENN Energy Holdings Ltd** | 2,63 % | 17.09.2030 | 428.238 | 0,44 |
| 206.000 | First Abu Dhabi Bank PJSC† | 5,13 % | 13.10.2027 | 207.792 | 0,21 |
| 233.000 | First Abu Dhabi Bank PJSC† | 6,32 % | 04.04.2034 | 240.345 | 0,25 |
| 300.000 | Formosa Group Cayman Ltd** | 3,38 % | 22.04.2025 | 292.986 | 0,30 |
| 400.000 | Franshion Brilliant Ltd† | 4,25 % | 23.07.2029 | 260.587 | 0,27 |
| 350.000 | FS Luxembourg Sarl** | 10,00 % | 15.12.2025 | 359.174 | 0,37 |
| 300.000 | Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd† | 2,63 % | 31.03.2036 | 248.126 | 0,25 |
| 279.936 | Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd† | 2,94 % | 30.09.2040 | 230.842 | 0,24 |
| 600.000 | GC Treasury Center Co Ltd† | 2,98 % | 18.03.2031 | 507.777 | 0,52 |
| 380.000 | GC Treasury Center Co Ltd† | 4,40 % | 30.03.2032 | 347.314 | 0,36 |

Sustainable Emerging Market Corporate Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 85,35 % (31. Dezember 2022: 88,54 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 234.000 | GCC SAB de CV** | 3,61 % | 20.04.2032 | 201.802 | 0,21 |
| 400.000 | GENM Capital Labuan Ltd* | 3,88 % | 19.04.2031 | 341.639 | 0,35 |
| 360.000 | Globe Telecom Inc* | 4,20 % | 29.12.2049 | 340.900 | 0,35 |
| 370.000 | Greenko Dutch BV** | 3,85 % | 29.03.2026 | 345.368 | 0,36 |
| 630.000 | Greenko Power II Ltd* | 4,30 % | 13.12.2028 | 569.520 | 0,59 |
| 200.000 | Greensaif Pipelines Bidco Sarl* | 6,51 % | 23.02.2042 | 211.505 | 0,22 |
| 300.000 | Grupo Aval Ltd* | 4,38 % | 04.02.2030 | 255.060 | 0,26 |
| 300.000 | Grupo Televisa SAB* | 6,63 % | 15.01.2040 | 314.451 | 0,32 |
| 257.037 | Guara Norte Sarl** | 5,20 % | 15.06.2034 | 234.444 | 0,24 |
| 300.000 | Hanwha Life Insurance Co Ltd** | 3,38 % | 04.02.2032 | 276.745 | 0,28 |
| 245.000 | HDFC Bank Ltd** | 3,70 % | 29.12.2049 | 223.574 | 0,23 |
| 203.000 | HPHT Finance 21 Ltd** | 2,00 % | 19.03.2026 | 190.011 | 0,19 |
| 575.000 | Huarong Finance II Co Ltd* | 5,50 % | 16.01.2025 | 569.969 | 0,58 |
| 200.000 | Hunt Oil Co of Peru LLC Sucursal Del Peru** | 8,55 % | 18.09.2033 | 218.883 | 0,22 |
| 300.000 | Hyundai Capital America** | 3,50 % | 02.11.2026 | 285.516 | 0,29 |
| 200.000 | IHS Holding Ltd** | 5,63 % | 29.11.2026 | 174.597 | 0,18 |
| 291.000 | IHS Netherlands Holdco BV** | 8,00 % | 18.09.2027 | 260.142 | 0,27 |
| 216.000 | Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT** | 3,40 % | 09.06.2031 | 187.157 | 0,19 |
| 300.000 | InRetail Consumer** | 3,25 % | 22.03.2028 | 269.471 | 0,28 |
| 300.000 | Inversiones CMPC SA** | 3,00 % | 06.04.2031 | 255.331 | 0,26 |
| 266.000 | Inversiones CMPC SA** | 6,13 % | 23.06.2033 | 275.583 | 0,28 |
| 200.000 | Investment Energy Resources Ltd* | 6,25 % | 26.04.2029 | 189.117 | 0,19 |
| 200.000 | Itau Unibanco Holding SA* | 3,88 % | 15.04.2031 | 191.697 | 0,20 |
| 161.000 | JSW Hydro Energy Ltd* | 4,13 % | 18.05.2031 | 140.454 | 0,14 |
| 240.000 | JSW Steel Ltd* | 5,05 % | 05.04.2032 | 207.249 | 0,21 |
| 350.000 | Kallpa Generacion SA* | 4,13 % | 16.08.2027 | 334.813 | 0,34 |
| 200.000 | Kasikornbank PCL* | 3,34 % | 02.10.2031 | 184.222 | 0,19 |
| 245.000 | Kasikornbank PCL* | 5,46 % | 07.03.2028 | 249.915 | 0,26 |
| 300.000 | KazMunayGas National Co JSC* | 3,50 % | 14.04.2033 | 250.073 | 0,26 |
| 600.000 | KazMunayGas National Co JSC* | 4,75 % | 19.04.2027 | 584.697 | 0,60 |
| 200.000 | KazMunayGas National Co JSC* | 5,38 % | 24.04.2030 | 198.766 | 0,20 |
| 550.000 | KazMunayGas National Co JSC* | 5,75 % | 19.04.2047 | 483.490 | 0,49 |
| 207.000 | Khazanah Capital Ltd* | 4,88 % | 01.06.2033 | 208.131 | 0,21 |
| 200.000 | Klabn Austria GmbH* | 7,00 % | 03.04.2049 | 202.335 | 0,21 |
| 223.000 | Kookmin Bank** | 2,50 % | 04.11.2030 | 185.854 | 0,19 |
| 700.000 | Kosmos Energy Ltd* | 7,13 % | 04.04.2026 | 668.015 | 0,68 |
| 200.000 | Kyobo Life Insurance Co Ltd* | 5,90 % | 15.06.2052 | 197.406 | 0,20 |
| 75.000 | Latam Airlines Group SA** | 13,38 % | 15.10.2029 | 85.961 | 0,09 |

Sustainable Emerging Market Corporate Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 85,35 % (31. Dezember 2022: 88,54 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 400.000 | Lenovo Group Ltd* | 3,42 % | 02.11.2030 | 353.489 | 0,36 |
| 309.038 | Leviathan Bond Ltd* | 6,75 % | 30.06.2030 | 282.942 | 0,29 |
| 229.000 | LG Chem Ltd* | 2,38 % | 07.07.2031 | 189.531 | 0,19 |
| 200.000 | LG Energy Solution Ltd** | 5,75 % | 25.09.2028 | 206.295 | 0,21 |
| 258.000 | MAF Global Securities Ltd* | 7,88 % | 29.12.2049 | 263.919 | 0,27 |
| 200.000 | MAF Sukuk Ltd* | 4,64 % | 14.05.2029 | 196.522 | 0,20 |
| 400.000 | MARB BondCo Plc* | 3,95 % | 29.01.2031 | 325.263 | 0,33 |
| 369.108 | MC Brazil Downstream Trading Sarl** | 7,25 % | 30.06.2031 | 289.728 | 0,30 |
| 600.000 | Medco Bell Pte Ltd** | 6,38 % | 30.01.2027 | 571.687 | 0,58 |
| 200.000 | MEGlobal BV** | 2,63 % | 28.04.2028 | 180.414 | 0,18 |
| 322.000 | MEGlobal Canada ULC* | 5,88 % | 18.05.2030 | 331.948 | 0,34 |
| 750.000 | Melco Resorts Finance Ltd** | 5,63 % | 17.07.2027 | 703.588 | 0,72 |
| 550.000 | Melco Resorts Finance Ltd* | 5,75 % | 21.07.2028 | 509.863 | 0,52 |
| 267.000 | Mersin Uluslararası Liman İşletmeciliği AS* | 8,25 % | 15.11.2028 | 279.140 | 0,29 |
| 200.000 | MGM China Holdings Ltd** | 4,75 % | 01.02.2027 | 190.420 | 0,20 |
| 200.000 | MHP Lux SA* | 6,95 % | 03.04.2026 | 155.500 | 0,16 |
| 250.000 | Millicom International Cellular SA** | 4,50 % | 27.04.2031 | 207.935 | 0,21 |
| 315.000 | Millicom International Cellular SA* | 6,25 % | 25.03.2029 | 298.861 | 0,31 |
| 679.000 | Minera Mexico SA de CV** | 4,50 % | 26.01.2050 | 548.280 | 0,56 |
| 494.000 | Minerva Luxembourg SA* | 4,38 % | 18.03.2031 | 407.775 | 0,42 |
| 200.000 | Minerva Luxembourg SA** | 8,88 % | 13.09.2033 | 211.809 | 0,22 |
| 300.000 | Minsur SA** | 4,50 % | 28.10.2031 | 265.479 | 0,27 |
| 300.000 | MTN Mauritius Investments Ltd* | 6,50 % | 13.10.2026 | 303.294 | 0,31 |
| 403.180 | MV24 Capital BV* | 6,75 % | 01.06.2034 | 377.705 | 0,39 |
| 215.673 | Nakilat Inc** | 6,07 % | 31.12.2033 | 222.872 | 0,23 |
| 388.000 | NBK SPC Ltd* | 1,63 % | 15.09.2027 | 351.855 | 0,36 |
| 359.000 | NBK Tier 1 Financing 2 Ltd* | 4,50 % | 29.12.2049 | 345.234 | 0,35 |
| 200.000 | Nemak SAB de CV** | 3,63 % | 28.06.2031 | 166.295 | 0,17 |
| 200.000 | Network i2i Ltd* | 5,65 % | 29.12.2049 | 198.086 | 0,20 |
| 343.000 | Nexa Resources SA** | 6,50 % | 18.01.2028 | 346.859 | 0,35 |
| 294.000 | Ooredoo International Finance Ltd* | 2,63 % | 08.04.2031 | 256.867 | 0,26 |
| 300.000 | Orbia Advance Corp SAB de CV* | 5,88 % | 17.09.2044 | 272.492 | 0,28 |
| 200.000 | Oversea-Chinese Banking Corp Ltd** | 1,83 % | 10.09.2030 | 188.208 | 0,19 |
| 262.000 | Oversea-Chinese Banking Corp Ltd* | 4,60 % | 15.06.2032 | 258.940 | 0,27 |
| 283.000 | Oztel Holdings SPC Ltd* | 6,63 % | 24.04.2028 | 296.549 | 0,30 |
| 300.000 | Periama Holdings LLC* | 5,95 % | 19.04.2026 | 296.322 | 0,30 |
| 200.000 | Power Finance Corp Ltd* | 3,95 % | 23.04.2030 | 185.183 | 0,19 |
| 400.000 | Prosus NV* | 3,83 % | 08.02.2051 | 251.599 | 0,26 |

Sustainable Emerging Market Corporate Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 85,35 % (31. Dezember 2022: 88,54 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 200.000 | Prosus NV* | 4,19 % | 19.01.2032 | 172.693 | 0,18 |
| 400.000 | Prudential Funding Asia Plc* | 2,95 % | 03.11.2033 | 352.278 | 0,36 |
| 241.000 | QNB Finance Ltd* | 2,63 % | 12.05.2025 | 231.793 | 0,24 |
| 367.000 | QNB Finance Ltd* | 2,75 % | 12.02.2027 | 342.870 | 0,35 |
| 390.000 | REC Ltd* | 2,25 % | 01.09.2026 | 360.582 | 0,37 |
| 295.000 | Rede D'or Finance Sarl** | 4,50 % | 22.01.2030 | 267.505 | 0,27 |
| 450.000 | Reliance Industries Ltd* | 2,88 % | 12.01.2032 | 385.866 | 0,39 |
| 378.000 | Reliance Industries Ltd* | 3,63 % | 12.01.2052 | 277.783 | 0,28 |
| 400.000 | ReNew Wind Energy AP2/ReNew Power Pvt Ltd other 9 Subsidiaries** | 4,50 % | 14.07.2028 | 355.843 | 0,36 |
| 337.000 | SABIC Capital I BV* | 2,15 % | 14.09.2030 | 288.589 | 0,30 |
| 231.000 | Sable International Finance Ltd** | 5,75 % | 07.09.2027 | 218.420 | 0,22 |
| 200.000 | Sagcor Financial Co Ltd** | 5,30 % | 13.05.2028 | 192.212 | 0,20 |
| 340.000 | Samarco Mineracao SA** | 9,50 % | 30.06.2031 | 285.940 | 0,29 |
| 200.000 | Sands China Ltd** | 4,30 % | 08.01.2026 | 192.197 | 0,20 |
| 275.000 | Sands China Ltd* | 5,38 % | 08.08.2025 | 271.370 | 0,28 |
| 950.000 | Sands China Ltd** | 5,65 % | 08.08.2028 | 942.660 | 0,96 |
| 327.000 | Sasol Financing USA LLC* | 8,75 % | 03.05.2029 | 333.972 | 0,34 |
| 475.000 | SEPLAT Energy Plc* | 7,75 % | 01.04.2026 | 437.950 | 0,45 |
| 232.000 | SF Holding Investment 2021 Ltd* | 3,13 % | 17.11.2031 | 201.587 | 0,21 |
| 282.000 | Shelf Drilling Holdings Ltd** | 9,63 % | 15.04.2029 | 276.165 | 0,28 |
| 600.000 | Shinhan Bank Co Ltd* | 4,38 % | 13.04.2032 | 556.270 | 0,57 |
| 350.000 | Shinhan Bank Co Ltd** | 4,50 % | 12.04.2028 | 347.403 | 0,36 |
| 200.000 | Siam Commercial Bank PCL** | 4,40 % | 11.02.2029 | 194.263 | 0,20 |
| 400.000 | SierraCol Energy Andina LLC** | 6,00 % | 15.06.2028 | 336.976 | 0,34 |
| 400.000 | SingTel Group Treasury Pte Ltd** | 1,88 % | 10.06.2030 | 339.803 | 0,35 |
| 200.000 | Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd** | 4,75 % | 05.08.2029 | 13.500 | 0,01 |
| 400.000 | Sitios Latinoamerica SAB de CV** | 5,38 % | 04.04.2032 | 372.219 | 0,38 |
| 208.000 | SK Battery America Inc** | 2,13 % | 26.01.2026 | 192.492 | 0,20 |
| 566.000 | SK Hynix Inc* | 2,38 % | 19.01.2031 | 459.429 | 0,47 |
| 266.000 | SK Hynix Inc* | 6,38 % | 17.01.2028 | 274.934 | 0,28 |
| 225.000 | SK Hynix Inc* | 6,50 % | 17.01.2033 | 237.724 | 0,24 |
| 300.000 | SNB Funding Ltd* | 2,90 % | 29.01.2027 | 281.547 | 0,29 |
| 446.000 | SNB Sukuk Ltd* | 2,34 % | 19.01.2027 | 412.793 | 0,42 |
| 200.000 | Standard Chartered Plc* | 1,46 % | 14.01.2027 | 183.334 | 0,19 |
| 400.000 | Standard Chartered Plc* | 4,30 % | 29.12.2049 | 326.208 | 0,33 |
| 300.000 | Standard Chartered Plc* | 6,30 % | 09.01.2029 | 307.818 | 0,32 |
| 483.000 | Standard Chartered Plc* | 6,30 % | 06.07.2034 | 507.589 | 0,52 |
| 200.000 | Star Energy Geothermal Darajat II/Star Energy Geothermal Salak* | 4,85 % | 14.10.2038 | 183.417 | 0,19 |

Sustainable Emerging Market Corporate Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 85,35 % (31. Dezember 2022: 88,54 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 400.000 | Studio City Finance Ltd* | 6,50 % | 15.01.2028 | 371.530 | 0,38 |
| 200.000 | Sun Hung Kai Properties Capital Market Ltd** | 3,75 % | 25.02.2029 | 188.219 | 0,19 |
| 276.000 | Suzano Austria GmbH** | 7,00 % | 16.03.2047 | 292.190 | 0,30 |
| 129.000 | Telecom Argentina SA** | 8,00 % | 18.07.2026 | 122.521 | 0,13 |
| 400.000 | Telecomunicaciones Digitales SA** | 4,50 % | 30.01.2030 | 345.160 | 0,35 |
| 390.000 | Telefonica Celular del Paraguay SA** | 5,88 % | 15.04.2027 | 380.016 | 0,39 |
| 200.000 | Telefonica Moviles Chile SA** | 3,54 % | 18.11.2031 | 147.897 | 0,15 |
| 283.000 | Tencent Holdings Ltd* | 3,24 % | 03.06.2050 | 188.961 | 0,19 |
| 429.000 | Tengizchevroil Finance Co International Ltd** | 3,25 % | 15.08.2030 | 354.534 | 0,36 |
| 500.000 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV* | 3,15 % | 01.10.2026 | 463.317 | 0,47 |
| 550.000 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV* | 4,10 % | 01.10.2046 | 373.061 | 0,38 |
| 300.000 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV** | 8,13 % | 15.09.2031 | 327.549 | 0,34 |
| 910.000 | Thaioil Treasury Center Co Ltd* | 3,75 % | 18.06.2050 | 642.036 | 0,66 |
| 200.000 | Total Play Telecomunicaciones SA de CV* | 6,38 % | 20.09.2028 | 81.506 | 0,08 |
| 150.000 | Transportadora de Gas del Sur SA* | 6,75 % | 02.05.2025 | 143.627 | 0,15 |
| 200.000 | Trust Fibra Uno** | 6,95 % | 30.01.2044 | 172.760 | 0,18 |
| 500.000 | TSMC Arizona Corp* | 1,75 % | 25.10.2026 | 461.090 | 0,47 |
| 400.000 | TSMC Arizona Corp* | 2,50 % | 25.10.2031 | 344.571 | 0,35 |
| 550.000 | TSMC Arizona Corp* | 3,25 % | 25.10.2051 | 436.133 | 0,45 |
| 893.000 | TSMC Arizona Corp* | 4,25 % | 22.04.2032 | 880.553 | 0,90 |
| 500.000 | TSMC Global Ltd* | 1,75 % | 23.04.2028 | 446.285 | 0,46 |
| 1.000.000 | TSMC Global Ltd* | 2,25 % | 23.04.2031 | 852.281 | 0,87 |
| 200.000 | Turk Telekomunikasyon AS* | 6,88 % | 28.02.2025 | 198.300 | 0,20 |
| 400.000 | Turkcell Iletisim Hizmetleri AS* | 5,80 % | 11.04.2028 | 380.384 | 0,39 |
| 200.000 | Turkiye Petrol Rafinerileri AS* | 4,50 % | 18.10.2024 | 196.978 | 0,20 |
| 215.000 | Turkiye Sise ve Cam Fabrikalari AS* | 6,95 % | 14.03.2026 | 214.596 | 0,22 |
| 657.000 | Turkiye Vakiflar Bankasi TAO* | 5,50 % | 01.10.2026 | 630.671 | 0,65 |
| 361.000 | Turkiye Vakiflar Bankasi TAO* | 9,00 % | 12.10.2028 | 379.462 | 0,39 |
| 400.000 | United Overseas Bank Ltd* | 2,00 % | 14.10.2031 | 364.605 | 0,37 |
| 300.000 | United Overseas Bank Ltd* | 3,75 % | 15.04.2029 | 298.526 | 0,31 |
| 500.000 | United Overseas Bank Ltd* | 3,86 % | 07.10.2032 | 478.385 | 0,49 |
| 302.000 | Vale Overseas Ltd* | 6,13 % | 12.06.2033 | 313.829 | 0,32 |
| 185.000 | Vale Overseas Ltd* | 6,88 % | 21.11.2036 | 202.053 | 0,21 |
| 600.000 | Vedanta Resources Finance II Plc* | 8,95 % | 11.03.2025 | 446.724 | 0,46 |
| 721.000 | VTR Finance NV** | 6,38 % | 15.07.2028 | 188.766 | 0,19 |
| 280.000 | WE Soda Investments Holding Plc** | 9,50 % | 06.10.2028 | 289.744 | 0,30 |
| 200.000 | Wharf REIC Finance BVI Ltd* | 3,50 % | 17.01.2028 | 188.230 | 0,19 |
| 300.000 | Woori Bank* | 4,75 % | 30.04.2024 | 299.043 | 0,31 |

Sustainable Emerging Market Corporate Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 85,35 % (31. Dezember 2022: 88,54 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 985.000 | Wynn Macau Ltd* | 5,63 % | 26.08.2028 | 913.168 | 0,93 |
| 200.000 | XP Inc** | 3,25 % | 01.07.2026 | 187.673 | 0,19 |
| 200.000 | Yapi ve Kredi Bankasi AS* | 5,85 % | 21.06.2024 | 199.812 | 0,20 |
| 495.000 | Yapi ve Kredi Bankasi AS** | 9,25 % | 16.10.2028 | 525.593 | 0,54 |
| 500.000 | YPF SA* | 6,95 % | 21.07.2027 | 447.886 | 0,46 |
| 490.000 | YPF SA** | 7,00 % | 15.12.2047 | 370.664 | 0,38 |
| 112.500 | YPF SA** | 8,50 % | 23.03.2025 | 109.634 | 0,11 |
| 285.000 | YPF SA* | 8,50 % | 28.07.2025 | 275.479 | 0,28 |
| 138.462 | YPF SA** | 9,00 % | 12.02.2026 | 140.879 | 0,14 |
| Unternehmensanleihen insgesamt | | | | 83.464.415 | 85,35 |
| Staatsanleihen 7,33 % (31. Dezember 2022: 4,48 %) | | | | | |
| Euro | | | | | |
| 6.298 | Argentine Republic Government International Bond | 0,50 % | 09.07.2029 | 2.505 | 0,00 |
| 200.000 | Bank Gospodarstwa Krajowego | 5,13 % | 22.02.2033 | 240.736 | 0,25 |
| 1.175.000 | Ivory Coast Government International Bond | 5,25 % | 22.03.2030 | 1.168.311 | 1,20 |
| 215.000 | Magyar Export-Import Bank Zrt | 6,00 % | 16.05.2029 | 252.603 | 0,26 |
| 1.375.000 | Romanian Government International Bond | 3,62 % | 26.05.2030 | 1.400.058 | 1,43 |
| 137.000 | Romanian Government International Bond | 6,38 % | 18.09.2033 | 160.344 | 0,16 |
| Euro insgesamt | | | | 3.224.557 | 3,30 |
| US-Dollar | | | | | |
| 300.000 | Airport Authority | 3,25 % | 12.01.2052 | 230.713 | 0,23 |
| 979.253 | Argentine Republic Government International Bond | 0,75 % | 09.07.2030 | 395.135 | 0,40 |
| 452.025 | Argentine Republic Government International Bond | 3,50 % | 09.07.2041 | 155.343 | 0,16 |
| 439.246 | Argentine Republic Government International Bond | 3,63 % | 09.07.2035 | 151.788 | 0,15 |
| 415.685 | Argentine Republic Government International Bond | 4,25 % | 09.01.2038 | 165.515 | 0,17 |
| 401.000 | Chile Government International Bond | 4,95 % | 05.01.2036 | 397.260 | 0,41 |
| 200.000 | Dominican Republic International Bond | 5,50 % | 22.02.2029 | 196.000 | 0,20 |
| 399.000 | Dominican Republic International Bond | 7,05 % | 03.02.2031 | 419.947 | 0,43 |
| 279.000 | Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp | 1,75 % | 15.04.2026 | 257.811 | 0,26 |
| 200.000 | Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp | 5,38 % | 11.05.2028 | 202.197 | 0,21 |
| 284.000 | Philippine Government International Bond | 5,50 % | 17.01.2048 | 300.237 | 0,31 |
| 400.000 | Turkiye Government International Bond | 5,95 % | 15.01.2031 | 377.988 | 0,39 |
| 295.000 | Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS | 9,38 % | 31.01.2026 | 309.187 | 0,32 |
| 156.000 | Ukraine Government International Bond | 7,75 % | 01.09.2027 | 43.153 | 0,04 |
| 500.000 | Ukraine Government International Bond | 7,75 % | 01.08.2041 | 225.553 | 0,23 |

Sustainable Emerging Market Corporate Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|---------------------------------------|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 7,33 % (31. Dezember 2022: 4,48 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 400.000 | Ukraine Government International Bond | 9,75 % | 01.11.2030 | 116.000 | 0,12 |
| US-Dollar insgesamt | | | | 3.943.827 | 4,03 |
| Staatsanleihen insgesamt * | | | | 7.168.384 | 7,33 |
| Anlagen insgesamt | | | | 90.632.799 | 92,68 |

Devisenterminkontrakte 1,95 % (31. Dezember 2022: 0,87 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeits- datum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Netto- vermögens |
|---|------------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------------|---------------------------|
| 2.910.933 US\$ | 2.630.498 € | 02.02.2024 | Citibank NA | 1 | 1.408 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> | | | | | | |
| 73.952 CHF | 85.413 US\$ | 14.03.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 3.101 | 0,00 |
| 13.800.809 CHF | 15.941.202 US\$ | 14.03.2024 | UBS AG | 2 | 577.118 | 0,59 |
| 332.492 CHF | 386.952 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | 11.011 | 0,01 |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 564.950 € | 612.606 US\$ | 14.03.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 13.265 | 0,01 |
| 53.481.552 € | 57.972.773 US\$ | 14.03.2024 | UBS AG | 1 | 1.275.864 | 1,31 |
| 1.067.160 € | 1.168.529 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 6 | 13.707 | 0,02 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 120 £ | 153 US\$ | 14.03.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 1 | 0,00 |
| 224.108 £ | 282.628 US\$ | 14.03.2024 | UBS AG | 1 | 3.167 | 0,00 |
| 271 £ | 342 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | 3 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i> | | | | | | |
| 24.059 SEK | 2.356 US\$ | 14.03.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 38 | 0,00 |
| 2.140.552 SEK | 205.011 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 4 | 7.992 | 0,01 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | 1.906.675 | 1,95 |

Futures-Kontrakte 0,03 % (31. Dezember 2022: 0,05 %)

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Netto- vermögens |
|---|---|--------------------------------------|------------------------------|
| 10 | US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2024 | 27.031 | 0,03 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten * | | 27.031 | 0,03 |

| | | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|--|-------------------|------------------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | | 92.566.505 | 94,66 |

Sustainable Emerging Market Corporate Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,24 %) (31. Dezember 2022: (0,14 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 2.630.498 € | 2.907.516 US\$ | 03.01.2024 | Citibank NA | 1 | (1.736) | (0,00) |
| 121.833 US\$ | 865.136 CNY | 20.03.2024 | Citibank NA | 2 | (319) | (0,00) |
| 2.878.281 US\$ | 2.630.498 € | 03.01.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | (27.498) | (0,03) |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 9.205.945 US\$ | 8.493.267 € | 14.03.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (203.177) | (0,21) |
| 1.093 US\$ | 1.000 € | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | (15) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 269.861 US\$ | 213.984 £ | 14.03.2024 | UBS AG | 1 | (3.024) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i> | | | | | | |
| 11.275 SEK | 1.129 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | (7) | (0,00) |
| 5.094 US\$ | 53.001 SEK | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 4 | (181) | (0,00) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | (235.957) | (0,24) |

Futures-Kontrakte (0,24 %) (31. Dezember 2022: (0,01 %))

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|--|---------------------------------|----------------------|
| (7) | Euro-Bund Future March 2024 | (9.677) | (0,01) |
| (38) | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2024 | (156.156) | (0,16) |
| (7) | US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2024 | (70.328) | (0,07) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten [*] | | (236.161) | (0,24) |

| | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|---|-------------------|----------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (472.118) | (0,48) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | 92.094.387 | 94,18 |
| Sonstiges Nettovermögen | 5.694.750 | 5,82 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | 97.789.137 | 100,00 |

| Portfolioanalyse | US\$ | % des Gesamtvermögens |
|---|-------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 59.605.545 | 60,53 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 31.027.254 | 31,51 |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | (209.130) | (0,21) |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente | 1.670.718 | 1,70 |
| Anlagen insgesamt | 92.094.387 | 93,53 |

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 6,31 % (31. Dezember 2022: 4,87 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 1.470.000 | Abu Dhabi Commercial Bank PJSC* | 4,50 % | 14.09.2027 | 1.446.561 | 0,32 |
| 799.000 | Adib Sukuk Co II Ltd* | 5,70 % | 15.11.2028 | 821.948 | 0,18 |
| 1.419.000 | Banco do Brasil SA** | 6,25 % | 18.04.2030 | 1.477.583 | 0,33 |
| 3.420.000 | Banque Ouest Africaine de Developpement* | 4,70 % | 22.10.2031 | 2.922.698 | 0,66 |
| 1.274.000 | Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais** | 5,33 % | 15.02.2028 | 1.255.311 | 0,28 |
| 560.000 | Cemex SAB de CV** | 5,13 % | 29.12.2049 | 531.542 | 0,12 |
| 1.623.000 | Cemex SAB de CV** | 9,13 % | 29.12.2049 | 1.730.304 | 0,39 |
| 913.000 | Eastern & Southern African Trade & Development Bank* | 4,88 % | 23.05.2024 | 903.386 | 0,20 |
| 1.521.000 | Emirates NBD Bank PJSC* | 5,88 % | 11.10.2028 | 1.574.296 | 0,35 |
| 490.000 | Empresa de los Ferrocarriles del Estado* | 3,07 % | 18.08.2050 | 298.849 | 0,07 |
| 4.460.000 | Empresa de los Ferrocarriles del Estado* | 3,83 % | 14.09.2061 | 3.068.156 | 0,69 |
| 2.200.000 | Gabon Blue Bond Master Trust Series 2† | 6,10 % | 01.08.2038 | 2.164.666 | 0,49 |
| 3.940.000 | Inversiones CMPC SA** | 3,00 % | 06.04.2031 | 3.353.346 | 0,75 |
| 1.940.000 | Suzano Austria GmbH* | 5,00 % | 15.01.2030 | 1.877.557 | 0,42 |
| 1.820.000 | Suzano Austria GmbH** | 7,00 % | 16.03.2047 | 1.927.045 | 0,43 |
| 600.000 | Telecomunicaciones Digitales SA** | 4,50 % | 30.01.2030 | 517.741 | 0,12 |
| 2.140.000 | Turkiye Vakiflar Bankasi TAO* | 9,00 % | 12.10.2028 | 2.249.440 | 0,51 |
| Unternehmensanleihen insgesamt | | | | 28.120.429 | 6,31 |
| Staatsanleihen 86,94 % (31. Dezember 2022: 85,91 %) | | | | | |
| Euro | | | | | |
| 1.281.234 | Argentine Republic Government International Bond* | 0,13 % | 09.07.2030 | 512.554 | 0,12 |
| 2.560.000 | Bank Gospodarstwa Krajowego* | 0,50 % | 08.07.2031 | 2.212.283 | 0,50 |
| 3.571.000 | Bank Gospodarstwa Krajowego* | 5,13 % | 22.02.2033 | 4.298.340 | 0,96 |
| 5.635.000 | Benin Government International Bond* | 4,95 % | 22.01.2035 | 4.921.406 | 1,10 |
| 1.600.000 | Bulgaria Government International Bond* | 4,13 % | 23.09.2029 | 1.822.796 | 0,41 |
| 1.636.000 | Bulgaria Government International Bond* | 4,38 % | 13.05.2031 | 1.901.643 | 0,43 |
| 2.180.000 | Bulgaria Government International Bond* | 4,50 % | 27.01.2033 | 2.534.692 | 0,57 |
| 450.000 | Bulgaria Government International Bond* | 4,88 % | 13.05.2036 | 533.132 | 0,12 |
| 11.600.022 | Chile Government International Bond* | 4,13 % | 05.07.2034 | 13.117.014 | 2,94 |
| 3.300.000 | Ivory Coast Government International Bond* | 5,25 % | 22.03.2030 | 3.281.215 | 0,74 |
| 2.750.000 | Ivory Coast Government International Bond* | 5,88 % | 17.10.2031 | 2.731.882 | 0,61 |
| 3.388.000 | Ivory Coast Government International Bond* | 6,63 % | 22.03.2048 | 2.994.043 | 0,67 |
| 7.485.000 | Ivory Coast Government International Bond* | 6,88 % | 17.10.2040 | 6.942.896 | 1,56 |
| 2.795.000 | Latvia Government International Bond* | 0,25 % | 23.01.2030 | 2.597.795 | 0,58 |
| 6.880.000 | Mexico Government International Bond* | 2,25 % | 12.08.2036 | 5.992.191 | 1,34 |
| 4.050.000 | Mexico Government International Bond* | 3,38 % | 23.02.2031 | 4.347.127 | 0,97 |
| 15.034.000 | Peruvian Government International Bond* | 1,25 % | 11.03.2033 | 13.076.528 | 2,93 |
| 6.547.000 | Peruvian Government International Bond* | 1,95 % | 17.11.2036 | 5.471.153 | 1,23 |

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 86,94 % (31. Dezember 2022: 85,91 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Euro (Fortsetzung) | | | | | |
| 4.685.000 | Peruvian Government International Bond* | 3,75 % | 01.03.2030 | 5.152.100 | 1,16 |
| 3.670.000 | Philippine Government International Bond* | 0,70 % | 03.02.2029 | 3.551.341 | 0,80 |
| 2.940.000 | Philippine Government International Bond* | 1,20 % | 28.04.2033 | 2.615.112 | 0,59 |
| 6.708.000 | Philippine Government International Bond* | 1,75 % | 28.04.2041 | 5.198.591 | 1,17 |
| 41.293 | Provincia de Buenos Aires* | 4,50 % | 01.09.2037 | 15.837 | 0,00 |
| 696.000 | Republic of Poland Government International Bond* | 4,25 % | 14.02.2043 | 812.808 | 0,18 |
| 2.966.000 | Romanian Government International Bond* | 2,00 % | 28.01.2032 | 2.544.226 | 0,57 |
| 3.030.000 | Romanian Government International Bond* | 2,00 % | 14.04.2033 | 2.514.551 | 0,56 |
| 2.202.000 | Romanian Government International Bond* | 2,12 % | 16.07.2031 | 1.946.630 | 0,44 |
| 771.000 | Romanian Government International Bond* | 2,63 % | 02.12.2040 | 574.702 | 0,13 |
| 755.000 | Romanian Government International Bond* | 2,88 % | 13.04.2042 | 566.158 | 0,13 |
| 2.833.000 | Romanian Government International Bond* | 3,38 % | 28.01.2050 | 2.143.689 | 0,48 |
| 6.785.000 | Romanian Government International Bond* | 3,62 % | 26.05.2030 | 6.908.651 | 1,55 |
| 16.528.000 | Romanian Government International Bond* | 3,75 % | 07.02.2034 | 15.787.650 | 3,54 |
| 3.560.000 | Romanian Government International Bond* | 3,88 % | 29.10.2035 | 3.363.718 | 0,75 |
| 275.000 | Romanian Government International Bond* | 6,38 % | 18.09.2033 | 321.858 | 0,07 |
| 11.738.000 | Serbia International Bond* | 1,50 % | 26.06.2029 | 10.981.968 | 2,46 |
| 11.132.000 | Serbia International Bond* | 1,65 % | 03.03.2033 | 9.121.420 | 2,05 |
| 4.652.000 | Serbia International Bond* | 2,05 % | 23.09.2036 | 3.588.934 | 0,80 |
| 1.276.000 | Ukraine Government International Bond** | 6,75 % | 20.06.2028 | 348.152 | 0,08 |
| Euro insgesamt | | | | 157.346.786 | 35,29 |
| US-Dollar | | | | | |
| 17.900.785 | Argentine Republic Government International Bond* | 0,75 % | 09.07.2030 | 7.223.087 | 1,62 |
| 216.342 | Argentine Republic Government International Bond* | 1,00 % | 09.07.2029 | 86.969 | 0,02 |
| 38.659.307 | Argentine Republic Government International Bond* | 3,63 % | 09.07.2035 | 13.359.310 | 3,00 |
| 2.346.000 | Bank Gospodarstwa Krajowego* | 5,38 % | 22.05.2033 | 2.383.604 | 0,53 |
| 3.685.000 | Brazilian Government International Bond* | 5,63 % | 07.01.2041 | 3.415.465 | 0,77 |
| 6.145.000 | Brazilian Government International Bond* | 5,63 % | 21.02.2047 | 5.417.537 | 1,21 |
| 8.846.000 | Brazilian Government International Bond* | 6,00 % | 20.10.2033 | 8.865.419 | 1,99 |
| 2.400.000 | Brazilian Government International Bond** | 6,25 % | 18.03.2031 | 2.493.843 | 0,56 |
| 1.090.000 | Chile Government International Bond* | 2,55 % | 27.07.2033 | 904.512 | 0,20 |
| 5.700.000 | Chile Government International Bond* | 3,50 % | 31.01.2034 | 5.095.298 | 1,14 |
| 200.000 | Chile Government International Bond* | 3,50 % | 15.04.2053 | 151.119 | 0,03 |
| 489.000 | Chile Government International Bond* | 4,34 % | 07.03.2042 | 438.433 | 0,10 |
| 1.454.000 | Chile Government International Bond* | 4,95 % | 05.01.2036 | 1.440.441 | 0,32 |
| 4.623.000 | Colombia Government International Bond* | 3,00 % | 30.01.2030 | 3.913.000 | 0,88 |

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 86,94 % (31. Dezember 2022: 85,91 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 3.777.000 | Colombia Government International Bond* | 3,88 % | 25.04.2027 | 3.611.435 | 0,81 |
| 3.202.000 | Colombia Government International Bond* | 5,00 % | 15.06.2045 | 2.495.527 | 0,56 |
| 4.576.000 | Colombia Government International Bond* | 5,20 % | 15.05.2049 | 3.589.721 | 0,81 |
| 2.915.000 | Colombia Government International Bond* | 6,13 % | 18.01.2041 | 2.659.179 | 0,60 |
| 14.534.000 | Colombia Government International Bond* | 7,50 % | 02.02.2034 | 15.377.365 | 3,45 |
| 2.868.000 | Colombia Government International Bond* | 8,00 % | 20.04.2033 | 3.133.362 | 0,70 |
| 890.000 | Colombia Government International Bond** | 8,00 % | 14.11.2035 | 975.422 | 0,22 |
| 660.000 | Colombia Government International Bond* | 8,75 % | 14.11.2053 | 760.488 | 0,17 |
| 1.290.000 | Colombia Government International Bond* | 10,38 % | 28.01.2033 | 1.563.325 | 0,35 |
| 4.759.000 | Costa Rica Government International Bond* | 6,55 % | 03.04.2034 | 4.940.437 | 1,10 |
| 5.993.000 | Costa Rica Government International Bond* | 7,16 % | 12.03.2045 | 6.376.552 | 1,43 |
| 2.234.000 | Costa Rica Government International Bond* | 7,30 % | 13.11.2054 | 2.429.475 | 0,54 |
| 3.900.000 | Dominican Republic International Bond* | 4,50 % | 30.01.2030 | 3.602.820 | 0,81 |
| 5.483.000 | Dominican Republic International Bond* | 5,88 % | 30.01.2060 | 4.756.228 | 1,07 |
| 2.210.000 | Dominican Republic International Bond* | 5,95 % | 25.01.2027 | 2.222.818 | 0,50 |
| 8.741.000 | Dominican Republic International Bond* | 6,00 % | 22.02.2033 | 8.642.664 | 1,94 |
| 6.282.000 | Dominican Republic International Bond* | 6,40 % | 05.06.2049 | 5.928.638 | 1,33 |
| 460.000 | Dominican Republic International Bond* | 7,05 % | 03.02.2031 | 484.150 | 0,11 |
| 7.281.000 | El Salvador Government International Bond* | 7,65 % | 15.06.2035 | 5.706.484 | 1,28 |
| 11.216.000 | El Salvador Government International Bond* | 9,50 % | 15.07.2052 | 9.393.957 | 2,11 |
| 858.000 | Fondo MIVIVIENDA SA* | 4,63 % | 12.04.2027 | 839.087 | 0,19 |
| 910.000 | Ghana Government International Bond* | 6,38 % | 11.02.2027 | 408.636 | 0,09 |
| 4.468.000 | Ghana Government International Bond* | 7,75 % | 07.04.2029 | 1.964.267 | 0,44 |
| 3.430.000 | Ghana Government International Bond* | 7,88 % | 26.03.2027 | 1.541.137 | 0,35 |
| 968.000 | Ghana Government International Bond* | 8,95 % | 26.03.2051 | 420.538 | 0,09 |
| 9.663.000 | Ghana Government International Bond* | 10,75 % | 14.10.2030 | 6.117.896 | 1,37 |
| 1.560.000 | Istanbul Metropolitan Municipality* | 10,50 % | 06.12.2028 | 1.659.450 | 0,37 |
| 1.809.121 | Ivory Coast Government International Bond* | 5,75 % | 31.12.2032 | 1.714.052 | 0,38 |
| 1.593.000 | Jordan Government International Bond* | 7,38 % | 10.10.2047 | 1.420.328 | 0,32 |
| 11.478.000 | Mexico Government International Bond* | 5,75 % | 12.10.2110 | 10.314.998 | 2,31 |
| 1.360.000 | Mongolia Government International Bond* | 7,88 % | 05.06.2029 | 1.392.629 | 0,31 |
| 9.929.000 | Morocco Government International Bond* | 3,00 % | 15.12.2032 | 8.192.458 | 1,84 |
| 10.126.000 | Morocco Government International Bond* | 6,50 % | 08.09.2033 | 10.704.225 | 2,40 |
| 1.373.000 | Peruvian Government International Bond* | 3,00 % | 15.01.2034 | 1.163.178 | 0,26 |
| 202.231 | Provincia de Mendoza Argentina* | 5,75 % | 19.03.2029 | 173.413 | 0,04 |
| 4.961.000 | Republic of Armenia International Bond* | 3,60 % | 02.02.2031 | 4.068.903 | 0,91 |
| 10.260.000 | Republic of Armenia International Bond* | 3,95 % | 26.09.2029 | 8.971.036 | 2,01 |
| 750.000 | Republic of Poland Government International Bond* | 5,50 % | 04.04.2053 | 783.972 | 0,18 |

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 86,94 % (31. Dezember 2022: 85,91 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 1.548.000 | Republic of Poland Government International Bond* | 5,75 % | 16.11.2032 | 1.674.766 | 0,38 |
| 800.000 | Republic of Uzbekistan International Bond* | 3,70 % | 25.11.2030 | 674.440 | 0,15 |
| 982.000 | Republic of Uzbekistan International Bond* | 5,38 % | 20.02.2029 | 932.447 | 0,21 |
| 3.254.000 | Sri Lanka Government International Bond* | 6,20 % | 11.05.2027 | 1.652.390 | 0,37 |
| 3.089.000 | Sri Lanka Government International Bond* | 6,75 % | 18.04.2028 | 1.561.670 | 0,35 |
| 7.800.000 | Sri Lanka Government International Bond* | 6,83 % | 18.07.2026 | 4.012.291 | 0,90 |
| 2.078.000 | Sri Lanka Government International Bond* | 6,85 % | 14.03.2024 | 1.058.171 | 0,24 |
| 5.337.000 | Sri Lanka Government International Bond* | 6,85 % | 03.11.2025 | 2.761.886 | 0,62 |
| 1.512.000 | Sri Lanka Government International Bond* | 7,55 % | 28.03.2030 | 763.365 | 0,17 |
| 2.655.000 | Sri Lanka Government International Bond* | 7,85 % | 14.03.2029 | 1.340.982 | 0,30 |
| 290.000 | Tunisian Republic* | 5,75 % | 30.01.2025 | 238.684 | 0,05 |
| 4.357.000 | Ukraine Government International Bond* | 6,88 % | 21.05.2031 | 1.016.052 | 0,23 |
| 1.873.000 | Ukraine Government International Bond* | 7,38 % | 25.09.2034 | 444.931 | 0,10 |
| 1.470.000 | Ukraine Government International Bond* | 7,75 % | 01.09.2027 | 406.631 | 0,09 |
| 1.865.000 | Ukraine Government International Bond* | 7,75 % | 01.09.2029 | 517.178 | 0,12 |
| 5.729.000 | Ukraine Government International Bond* | 7,75 % | 01.08.2041 | 2.584.392 | 0,58 |
| 10.367.000 | Ukraine Government International Bond* | 9,75 % | 01.11.2030 | 3.006.430 | 0,67 |
| US-Dollar insgesamt | | | | 230.334.993 | 51,65 |
| Staatsanleihen insgesamt | | | | 387.681.779 | 86,94 |
| Anlagen insgesamt | | | | 415.802.208 | 93,25 |

Devisenterminkontrakte 1,97 % (31. Dezember 2022: 0,78 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeits- datum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Netto- vermögens |
|---|------------------------|-----------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------------|---------------------------|
| 5.288.142 € | 5.765.214 US\$ | 03.01.2024 | Citibank NA | 2 | 76.332 | 0,02 |
| 162.976.008 US\$ | 147.309.589 € | 02.02.2024 | Citibank NA | 1 | 40.766 | 0,01 |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 346.171.936 € | 375.133.372 US\$ | 14.03.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | 8.367.376 | 1,88 |
| 4.929.135 € | 5.344.209 US\$ | 14.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 116.450 | 0,02 |
| 13.095.613 € | 14.327.467 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 7 | 180.289 | 0,04 |
| 16.772 US\$ | 15.060 € | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 88 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | 8.781.301 | 1,97 |

Futures-Kontrakte 1,70 % (31. Dezember 2022: 1,59 %)

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Netto- vermögens |
|---------------------|--|--------------------------------------|---------------------------|
| 7 | Euro-Schatz Future March 2024 | 3.518 | 0,00 |
| 62 | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2024 | 254.297 | 0,06 |

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Futures-Kontrakte 1,70 % (31. Dezember 2022: 1,59 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---|--------------------------------|-----------------------------|
| 148 | US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2024 | 334.156 | 0,07 |
| 680 | US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2024 | 1.755.438 | 0,39 |
| 275 | US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2024 | 2.316.828 | 0,52 |
| 242 | US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2024 | 2.926.750 | 0,66 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten * | | 7.590.987 | 1,70 |
| | | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | | 432.174.496 | 96,92 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,46 %) (31. Dezember 2022: (0,54 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 147.309.589 € | 162.784.461 US\$ | 03.01.2024 | Citibank NA | 1 | (58.904) | (0,01) |
| 2.406.387 US\$ | 2.205.037 € | 03.01.2024 | Citibank NA | 1 | (29.407) | (0,01) |
| 159.526.156 US\$ | 145.770.694 € | 03.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | (1.499.461) | (0,33) |
| 5.076.021 US\$ | 4.622.000 € | 03.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | (29.672) | (0,01) |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 2.105.047 € | 2.337.627 US\$ | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (5.587) | (0,00) |
| 26.343.993 US\$ | 24.166.119 € | 14.03.2024 | Westpac Banking Corp | 12 | (428.035) | (0,10) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ** | | | | | (2.051.066) | (0,46) |

Futures-Kontrakte (0,82 %) (31. Dezember 2022: (0,03 %))

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|--|---------------------------------|-----------------------------|
| (58) | Euro-BOBL Future March 2024 | (92.470) | (0,02) |
| (677) | Euro-Bund Future March 2024 | (2.450.776) | (0,55) |
| (125) | Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2024 | (1.112.383) | (0,25) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten * | | (3.655.629) | (0,82) |
| | | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | | (5.706.695) | (1,28) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | | 426.467.801 | 95,64 |
| Sonstiges Nettovermögen | | 19.424.469 | 4,36 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | | 445.892.270 | 100,00 |

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

| Portfolioanalyse | US\$ | % des Gesamtvermögens |
|---|--------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 399.027.253 | 88,31 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 14.610.289 | 3,23 |
| † Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente | 2.164.666 | 0,48 |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 3.935.358 | 0,87 |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente | 6.730.235 | 1,49 |
| Anlagen insgesamt | 426.467.801 | 94,38 |

Tactical Macro – Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|-----------------------------------|-----------------------------|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Schatzwechsel 84,66 % | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 16.01.2024 | 4.989.787 | 18,37 |
| 6.805.800 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 30.01.2024 | 6.777.809 | 24,96 |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 06.02.2024 | 4.974.360 | 18,31 |
| 5.200.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 15.02.2024 | 5.166.722 | 19,02 |
| 547.700 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 05.03.2024 | 542.723 | 2,00 |
| 548.800 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 19.03.2024 | 542.702 | 2,00 |
| Schatzwechsel insgesamt ** | | | | 22.994.103 | 84,66 |
| Anlagen insgesamt | | | | 22.994.103 | 84,66 |

Devisenterminkontrakte 0,25 %

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeits- datum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Netto- vermögens |
|---|------------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| 1.980.280 AUD | 1.341.145 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 10.803 | 0,04 |
| 2.495.300 € | 2.151.173 £ | 11.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 14.858 | 0,05 |
| 179.927.607 ¥ | 990.300 £ | 11.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 15.391 | 0,06 |
| 193.091.294 ¥ | 1.346.660 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | 26.279 | 0,10 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ** | | | | | 67.331 | 0,25 |

Futures-Kontrakte 0,03 %

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Netto- vermögens |
|---|-------------------------------|--------------------------------------|------------------------------|
| 4 | TOPIX Index Future March 2024 | 8.973 | 0,03 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten * | | | 8.973 |

Gekaufte Optionskontrakte 1,32 %

| Anzahl Kontrakte/ Nominalwert | Fällig- keit | Art | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|----------------------------------|-----------------|--|------------------|------------------------------|
| Kaufoptionen | | | | |
| 62 | 13.12.2024 | 3 Month SOFR Future, Strike Price \$96.50 ± | 67.038 | 0,25 |
| 91 | 13.09.2024 | 3 Month SOFR Future, Strike Price \$95.50 ± | 142.756 | 0,52 |
| 1.627.000 USD | 24.01.2024 | United States Dollar/Japanese Yen Currency Option, Strike Price 147.50 ∞ | 587 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen | | | | |
| 34 | 21.06.2024 | E-mini Russell 2000 Index Future, Strike Price \$1,800.00 ± | 57.290 | 0,21 |
| 5 | 21.06.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$3,800.00 ± | 10.425 | 0,04 |

Tactical Macro – Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 1,32 % (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/ Nominalwert | Fällig- keit | Art | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|-----------------|---|------------------|------------------------------|
| Verkaufsoptionen (Fortsetzung) | | | | |
| 1.627.000 USD | 24.01.2024 | United States Dollar/Japanese Yen Currency Option, Strike Price 147.50 [∞] | 81.203 | 0,30 |
| Beizulegender Zeitwert aus gekauften Optionskontrakten insgesamt (Prämie: (331.192) US\$) | | | 359.299 | 1,32 |

Die Gegenpartei für alle OTC-Optionskontrakte ist Goldman Sachs International.

| | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|-------------------|------------------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 23.429.706 | 86,26 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,14 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeits- datum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Netto- vermögens |
|--|------------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------|--|---------------------------|
| 1.074.188 € | 1.247.650 € | 11.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (9.213) | (0,03) |
| 514.960 € | 94.350.353 ¥ | 11.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (13.594) | (0,05) |
| 673.330 US\$ | 96.667.294 ¥ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (14.004) | (0,06) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | (36.811) | (0,14) |

Futures Kontrakte (0,10 %)

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Netto- vermögens |
|---|---|--|---------------------------|
| (2) | Japan Government 10-Year Bond (OSE) Future March 2024 | (28.337) | (0,10) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten [‡] | | (28.337) | (0,10) |

Verkaufte Optionskontrakte (0,73 %)

| Anzahl Kontrakte/ Nominalwert | Fällig- keit | Art | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|---|-----------------|---|------------------|------------------------------|
| Kaufoptionen | | | | |
| 62 | 13.12.2024 | 3 Month SOFR Future, Strike Price \$97.50 [‡] | (26.738) | (0,10) |
| 91 | 13.09.2024 | 3 Month SOFR Future, Strike Price \$96.00 [‡] | (88.725) | (0,33) |
| (1.627.000) USD | 24.01.2024 | United States Dollar/Japanese Yen Currency Option, Strike Price 147.50 [∞] | (587) | (0,00) |
| Verkaufsoptionen | | | | |
| (1.627.000) USD | 24.01.2024 | United States Dollar/Japanese Yen Currency Option, Strike Price 147.50 [∞] | (81.203) | (0,30) |
| Beizulegender Zeitwert aus verkauften Optionskontrakten insgesamt (Prämie: 142.462 US\$) | | | (197.253) | (0,73) |

Die Gegenpartei für alle OTC-Optionskontrakte ist Goldman Sachs International.

Tactical Macro – Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|-------------------|------------------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (262.401) | (0,97) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | 23.167.305 | 85,29 |
| Sonstiges Nettovermögen | 3.995.003 | 14,71 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | 27.162.308 | 100,00 |

| Portfolioanalyse | US\$ | % des Gesamtver- mögens |
|--|-------------------|--|
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 22.994.103 | 83,56 |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 142.682 | 0,52 |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente | 30.520 | 0,11 |
| Anlagen insgesamt | 23.167.305 | 84,19 |

Ultra Short Term Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert EUR | % des Netto- vermögens |
|---|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| Schatzwechsel 0,90 % (31. Dezember 2022: 0,00 %) | | | | | |
| Euro | | | | | |
| 9.000.000 | Finland T-Bill | 0,00 % | 13.02.2024 | 8.960.964 | 0,90 |
| Schatzwechsel insgesamt ** | | | | 8.960.964 | 0,90 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 9,14 % (31. Dezember 2022: 8,81 %) | | | | | |
| Euro | | | | | |
| 5.933.234 | Clavel Residential 3 DAC Series 2023-1X Class A | 5,35 % | 28.01.2076 | 5.903.129 | 0,59 |
| 818.750 | Domi BV Series 2020-1 Class A | 4,77 % | 15.04.2052 | 820.439 | 0,08 |
| 1.500.000 | Domi BV Series 2020-2 Class B | 5,50 % | 15.11.2052 | 1.494.394 | 0,15 |
| 12.329.175 | Dutch Property Finance BV Series 2021-2 Class A | 4,65 % | 28.04.2059 | 12.290.298 | 1,24 |
| 1.940.185 | Dutch Property Finance BV Series 2022-2 Class A | 4,85 % | 28.04.2062 | 1.939.752 | 0,20 |
| 826.405 | European Residential Loan Securitisation 2019-NPL2 DAC Class A | 6,88 % | 24.02.2058 | 820.837 | 0,08 |
| 2.110.702 | Futura S.r.l. Series 2019-1 Class A | 6,97 % | 31.07.2044 | 2.103.235 | 0,21 |
| 191.515 | Gedesco Trade Receivables Designated Activity Co Series 2020-1 Class A | 5,03 % | 24.01.2026 | 183.309 | 0,02 |
| 3.199.143 | Jubilee Place Retail Unit Trust LP Series 3 Class A | 4,84 % | 17.01.2059 | 3.202.295 | 0,32 |
| 6.178.334 | Merrion Square Residential Series 2023-1 DAC Class A | 4,88 % | 24.10.2064 | 6.141.802 | 0,62 |
| 9.819.719 | MIRAVET Sarl Series 2019-1 Class A | 4,71 % | 26.05.2065 | 9.706.390 | 0,98 |
| 3.225.976 | MIRAVET Sarl Series 2020-1 Class A | 4,81 % | 26.05.2065 | 3.206.694 | 0,32 |
| 5.156.990 | Mulcair Securities No. 3 DAC Series 3 Class A | 4,92 % | 24.04.2065 | 5.130.998 | 0,52 |
| 350.544 | Primrose Residential 2021-1 DAC Series 2021-1 Class A | 4,63 % | 24.03.2061 | 350.756 | 0,04 |
| 1.500.000 | Primrose Residential Series 2021-1 Class B | 5,23 % | 24.03.2061 | 1.487.470 | 0,15 |
| 5.317.715 | Primrose Residential Series 2022-1 Class A | 4,88 % | 24.10.2061 | 5.304.963 | 0,53 |
| 3.500.000 | Primrose Residential Series 2022-1 Class D | 6,28 % | 24.10.2061 | 3.251.335 | 0,33 |
| 7.000.000 | Quarzo Series 2023-1 Class A1 | 4,88 % | 15.12.2039 | 7.020.398 | 0,71 |
| 4.338.180 | Red & Black Auto Italy SRL Series 2 Class A1 | 4,87 % | 28.07.2034 | 4.356.639 | 0,44 |
| 2.900.000 | RED & Black Auto Lease France Series 2 Class A | 4,56 % | 27.06.2035 | 2.905.011 | 0,29 |
| 186.495 | Retiro Mortgage Securities Series 1X Class A1 | 5,00 % | 30.07.2075 | 185.862 | 0,02 |
| 1.300.000 | Shamrock Residential DAC Series 2022-1 Class C | 5,78 % | 24.01.2061 | 1.270.859 | 0,13 |
| 2.500.000 | Shamrock Residential DAC Series 2023-1X Class C | 6,63 % | 24.06.2071 | 2.429.248 | 0,24 |
| 4.900.000 | Stresa Securitisation SRL Series 1 Class A | 5,17 % | 22.12.2045 | 4.750.643 | 0,48 |
| 712.722 | Tagus - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA Series 2019 Class A1 | 5,82 % | 12.05.2025 | 716.763 | 0,07 |
| 2.627.303 | Tagus - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA Series 3 Class C | 7,55 % | 23.06.2039 | 2.650.668 | 0,27 |
| 1.101.297 | Warrington Residential 2022-1 DAC Series 2022-1 Class A1 | 5,88 % | 24.12.2056 | 1.062.973 | 0,11 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt ** | | | | 90.687.160 | 9,14 |
| Unternehmensanleihen 79,48 % (31. Dezember 2022: 81,63 %) | | | | | |
| Euro | | | | | |
| 2.000.000 | AbbVie Inc* | 1,25 % | 01.06.2024 | 1.978.160 | 0,20 |
| 100.000 | ABN AMRO Bank NV* | 3,75 % | 20.04.2025 | 100.408 | 0,01 |
| 200.000 | Accor SA* | 2,63 % | 29.12.2049 | 195.453 | 0,02 |

Ultra Short Term Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert EUR | % des Nettöver- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 79,48 % (31. Dezember 2022: 81,63 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Euro (Fortsetzung) | | | | | |
| 23.000.000 | Aegon Bank NV [*] | 0,38 % | 21.11.2024 | 22.366.787 | 2,25 |
| 100.000 | Afflelou SAS [*] | 4,25 % | 19.05.2026 | 99.875 | 0,01 |
| 2.000.000 | ALD SA [*] | 1,25 % | 02.03.2026 | 1.910.618 | 0,19 |
| 2.600.000 | Allianz SE [*] | 2,60 % | 29.12.2049 | 1.893.658 | 0,19 |
| 200.000 | Allwyn International AS ^{**} | 3,88 % | 15.02.2027 | 193.000 | 0,02 |
| 1.000.000 | Altice France SA [*] | 3,38 % | 15.01.2028 | 796.379 | 0,08 |
| 1.000.000 | Altice France SA ^{**} | 4,13 % | 15.01.2029 | 802.220 | 0,08 |
| 9.000.000 | AMCO - Asset Management Co SpA ^{**} | 1,38 % | 27.01.2025 | 8.765.730 | 0,88 |
| 1.090.000 | AMCO - Asset Management Co SpA [*] | 4,63 % | 06.02.2027 | 1.120.161 | 0,11 |
| 3.600.000 | American Tower Corp [*] | 0,40 % | 15.02.2027 | 3.283.546 | 0,33 |
| 2.000.000 | American Tower Corp [*] | 0,45 % | 15.01.2027 | 1.831.074 | 0,18 |
| 700.000 | American Tower Corp [*] | 1,95 % | 22.05.2026 | 675.690 | 0,07 |
| 800.000 | ANZ New Zealand Int'l Ltd [*] | 3,95 % | 17.07.2026 | 819.093 | 0,08 |
| 400.000 | APA Infrastructure Ltd [*] | 7,13 % | 09.11.2083 | 421.046 | 0,04 |
| 200.000 | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc [*] | 2,00 % | 01.09.2028 | 178.051 | 0,02 |
| 100.000 | Arena Luxembourg Finance Sarl [*] | 1,88 % | 01.02.2028 | 89.669 | 0,01 |
| 2.000.000 | Arkema SA [*] | 1,50 % | 29.12.2049 | 1.858.150 | 0,19 |
| 5.000.000 | Arkema SA [*] | 2,75 % | 29.12.2049 | 4.955.750 | 0,50 |
| 5.000.000 | Aroundtown SA [*] | 0,38 % | 15.04.2027 | 4.034.750 | 0,41 |
| 4.100.000 | Aroundtown SA [*] | 1,63 % | 31.01.2028 | 3.335.095 | 0,34 |
| 400.000 | Aroundtown SA [*] | 2,13 % | 29.12.2049 | 147.135 | 0,01 |
| 4.900.000 | Aroundtown SA [*] | 3,38 % | 29.12.2049 | 2.065.458 | 0,21 |
| 4.000.000 | Arval Service Lease SA [*] | 0,00 % | 01.10.2025 | 3.766.584 | 0,38 |
| 8.000.000 | Arval Service Lease SA [*] | 3,38 % | 04.01.2026 | 7.998.688 | 0,81 |
| 1.800.000 | Arval Service Lease SA [*] | 4,13 % | 13.04.2026 | 1.822.883 | 0,18 |
| 1.700.000 | Arval Service Lease SA [*] | 4,25 % | 11.11.2025 | 1.720.830 | 0,17 |
| 2.900.000 | Arval Service Lease SA [*] | 4,63 % | 02.12.2024 | 2.915.480 | 0,29 |
| 500.000 | Ashland Services BV ^{**} | 2,00 % | 30.01.2028 | 465.933 | 0,05 |
| 100.000 | Assemblin Group AB ^{**} | 8,96 % | 05.07.2029 | 101.738 | 0,01 |
| 100.000 | AT&T Inc [*] | 3,55 % | 18.11.2025 | 100.599 | 0,01 |
| 10.900.000 | Athene Global Funding [*] | 0,37 % | 10.09.2026 | 9.994.002 | 1,01 |
| 9.000.000 | Athene Global Funding [*] | 0,83 % | 08.01.2027 | 8.312.535 | 0,84 |
| 5.000.000 | Athene Global Funding [*] | 1,24 % | 08.04.2024 | 4.958.018 | 0,50 |
| 2.400.000 | AusNet Services Holdings Pty Ltd [*] | 1,63 % | 11.03.2081 | 2.171.480 | 0,22 |
| 11.900.000 | Australia & New Zealand Banking Group Ltd [*] | 3,44 % | 04.04.2025 | 11.915.340 | 1,20 |
| 8.400.000 | Autostrade per l'Italia SpA [*] | 2,00 % | 04.12.2028 | 7.734.056 | 0,78 |
| 2.400.000 | Balder Finland OYJ [*] | 1,00 % | 18.01.2027 | 2.036.606 | 0,21 |
| 2.000.000 | Banco BPM SpA [*] | 3,88 % | 18.09.2026 | 2.037.566 | 0,21 |
| 200.000 | Banco BPM SpA [*] | 6,00 % | 14.06.2028 | 209.614 | 0,02 |

Ultra Short Term Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert EUR | % des Nettöver- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 79,48 % (31. Dezember 2022: 81,63 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Euro (Fortsetzung) | | | | | |
| 1.000.000 | Banco de Credito Social Cooperativo SA* | 7,50 % | 14.09.2029 | 1.050.924 | 0,11 |
| 500.000 | Banco de Sabadell SA* | 2,63 % | 24.03.2026 | 490.384 | 0,05 |
| 10.200.000 | Banco Santander SA* | 0,10 % | 26.01.2025 | 10.174.000 | 1,02 |
| 100.000 | Banco Santander SA* | 3,75 % | 16.01.2026 | 100.890 | 0,01 |
| 1.200.000 | Banjay Entertainment SASU** | 7,00 % | 01.05.2029 | 1.269.050 | 0,13 |
| 2.000.000 | Bank of America Corp* | 1,78 % | 04.05.2027 | 1.922.112 | 0,19 |
| 15.000.000 | Bank of Nova Scotia* | 3,05 % | 31.10.2024 | 14.938.230 | 1,50 |
| 4.700.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA* | 0,01 % | 07.03.2025 | 4.504.546 | 0,45 |
| 500.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA* | 0,01 % | 11.05.2026 | 464.942 | 0,05 |
| 11.800.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA* | 2,78 % | 29.12.2049 | 9.888.400 | 1,00 |
| 6.510.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA* | 3,21 % | 29.12.2049 | 5.476.212 | 0,55 |
| 5.000.000 | Barclays Plc* | 0,75 % | 09.06.2025 | 4.924.555 | 0,50 |
| 7.000.000 | Barclays Plc* | 2,89 % | 31.01.2027 | 6.887.302 | 0,69 |
| 2.000.000 | Bayer AG* | 6,63 % | 25.09.2083 | 2.043.260 | 0,21 |
| 200.000 | Bayer Capital Corp BV* | 1,50 % | 26.06.2026 | 190.686 | 0,02 |
| 2.500.000 | Bayerische Landesbank* | 7,00 % | 05.01.2034 | 2.594.160 | 0,26 |
| 1.850.000 | BCP V Modular Services Finance II Plc** | 4,75 % | 30.11.2028 | 1.723.499 | 0,17 |
| 7.000.000 | BNP Paribas SA* | 0,25 % | 13.04.2027 | 6.500.620 | 0,65 |
| 200.000 | BPCE SA* | 0,38 % | 02.02.2026 | 188.625 | 0,02 |
| 6.000.000 | BPCE SA* | 0,63 % | 28.04.2025 | 5.779.566 | 0,58 |
| 9.000.000 | BPCE SFH SA* | 0,13 % | 31.03.2025 | 8.657.820 | 0,87 |
| 1.300.000 | CA Auto Bank SpA* | 0,00 % | 16.04.2024 | 1.286.082 | 0,13 |
| 2.300.000 | CA Auto Bank SPA* | 4,75 % | 25.01.2027 | 2.378.379 | 0,24 |
| 100.000 | Caixa Central de Credito Agricola Mutuo CRL* | 8,38 % | 04.07.2027 | 104.086 | 0,01 |
| 5.000.000 | Canadian Imperial Bank of Commerce* | 0,38 % | 10.03.2026 | 4.721.800 | 0,48 |
| 5.500.000 | Capital One Financial Corp* | 0,80 % | 12.06.2024 | 5.413.391 | 0,55 |
| 4.400.000 | Carrier Global Corp* | 4,38 % | 29.05.2025 | 4.439.666 | 0,45 |
| 200.000 | Celanese US Holdings LLC* | 2,13 % | 01.03.2027 | 191.333 | 0,02 |
| 100.000 | Cellnex Telecom SA* | 1,75 % | 23.10.2030 | 87.862 | 0,01 |
| 800.000 | Cirsa Finance International Sarl* | 4,50 % | 15.03.2027 | 772.248 | 0,08 |
| 100.000 | Cirsa Finance International Sarl* | 7,88 % | 31.07.2028 | 104.645 | 0,01 |
| 8.000.000 | Citigroup Inc* | 1,25 % | 06.07.2026 | 7.705.264 | 0,78 |
| 5.700.000 | Citigroup Inc* | 1,50 % | 24.07.2026 | 5.505.283 | 0,55 |
| 4.000.000 | CK Hutchison Finance 16 II Ltd* | 0,88 % | 03.10.2024 | 3.898.836 | 0,39 |
| 200.000 | Commerzbank AG* | 0,10 % | 11.09.2025 | 189.660 | 0,02 |
| 2.200.000 | Commerzbank AG* | 6,75 % | 05.10.2033 | 2.347.400 | 0,24 |
| 900.000 | CPI Property Group SA* | 1,63 % | 23.04.2027 | 663.420 | 0,07 |
| 1.500.000 | CPI Property Group SA* | 2,75 % | 12.05.2026 | 1.256.020 | 0,13 |
| 6.000.000 | Credit Agricole Home Loan SFH SA* | 0,13 % | 16.12.2024 | 5.818.515 | 0,59 |
| 11.000.000 | Credit Agricole Home Loan SFH SA* | 0,38 % | 30.09.2024 | 10.747.836 | 1,08 |

Ultra Short Term Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert EUR | % des Nettöver- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 79,48 % (31. Dezember 2022: 81,63 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Euro (Fortsetzung) | | | | | |
| 14.000.000 | Credit Mutuel Home Loan SFH SA [*] | 0,63 % | 10.02.2025 | 13.585.880 | 1,37 |
| 6.600.000 | Credit Suisse AG [*] | 0,25 % | 05.01.2026 | 6.197.684 | 0,62 |
| 2.000.000 | Credit Suisse AG [*] | 1,50 % | 10.04.2026 | 1.916.375 | 0,19 |
| 2.000.000 | Credit Suisse AG [*] | 2,13 % | 31.05.2024 | 1.983.980 | 0,20 |
| 2.400.000 | Cullinan Holdco Scsp ^{**} | 4,63 % | 15.10.2026 | 1.876.080 | 0,19 |
| 700.000 | Deutsche Bank AG [*] | 1,00 % | 19.11.2025 | 680.966 | 0,07 |
| 200.000 | Deutsche Lufthansa AG [*] | 3,50 % | 14.07.2029 | 195.226 | 0,02 |
| 3.000.000 | Deutsche Postbank Funding Trust III [*] | 3,13 % | 29.12.2049 | 2.282.250 | 0,23 |
| 4.000.000 | Digital Euro Finco LLC [*] | 2,50 % | 16.01.2026 | 3.898.472 | 0,39 |
| 4.906.000 | Digital Euro Finco LLC [*] | 2,63 % | 15.04.2024 | 4.878.296 | 0,49 |
| 1.300.000 | doValue SpA [*] | 3,38 % | 31.07.2026 | 1.175.372 | 0,12 |
| 500.000 | doValue SpA ^{**} | 5,00 % | 04.08.2025 | 489.920 | 0,05 |
| 100.000 | Dufry One BV [*] | 3,38 % | 15.04.2028 | 95.637 | 0,01 |
| 3.000.000 | easyJet FinCo BV [*] | 1,88 % | 03.03.2028 | 2.808.095 | 0,28 |
| 1.200.000 | Electricite de France SA [*] | 2,88 % | 29.12.2049 | 1.115.519 | 0,11 |
| 1.600.000 | Electricite de France SA [*] | 3,75 % | 05.06.2027 | 1.632.418 | 0,16 |
| 1.500.000 | Electricite de France SA [*] | 4,00 % | 29.12.2049 | 1.490.911 | 0,15 |
| 1.000.000 | Emeria SASU ^{**} | 3,38 % | 31.03.2028 | 861.550 | 0,09 |
| 200.000 | EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG [*] | 1,38 % | 31.08.2081 | 171.167 | 0,02 |
| 1.000.000 | EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG [*] | 1,88 % | 29.06.2080 | 935.870 | 0,09 |
| 2.500.000 | EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG [*] | 2,13 % | 31.08.2081 | 1.955.770 | 0,20 |
| 200.000 | Enel Finance International NV [*] | 0,00 % | 28.05.2026 | 185.667 | 0,02 |
| 1.500.000 | Enel SpA [*] | 1,38 % | 29.12.2049 | 1.314.300 | 0,13 |
| 1.000.000 | Energia Group Roi Financeco DAC ^{**} | 6,88 % | 31.07.2028 | 1.040.900 | 0,10 |
| 1.000.000 | Energizer Gamma Acquisition BV ^{**} | 3,50 % | 30.06.2029 | 865.320 | 0,09 |
| 2.500.000 | Engie SA [*] | 1,88 % | 29.12.2049 | 2.078.932 | 0,21 |
| 2.000.000 | Eni SpA [*] | 3,38 % | 29.12.2049 | 1.840.054 | 0,19 |
| 500.000 | Evonik Industries AG [*] | 1,38 % | 02.09.2081 | 444.577 | 0,04 |
| 2.800.000 | Fastighets AB Balder [*] | 1,13 % | 29.01.2027 | 2.401.330 | 0,24 |
| 6.700.000 | Fastighets AB Balder [*] | 1,88 % | 23.01.2026 | 6.120.559 | 0,62 |
| 23.000.000 | Federation des Caisses Desjardins du Quebec [*] | 2,88 % | 28.11.2024 | 22.858.182 | 2,30 |
| 100.000 | Forvia SE [*] | 2,63 % | 15.06.2025 | 98.341 | 0,01 |
| 100.000 | Forvia SE [*] | 2,75 % | 15.02.2027 | 95.974 | 0,01 |
| 500.000 | Global Payments Inc [*] | 4,88 % | 17.03.2031 | 526.197 | 0,05 |
| 200.000 | Goldman Sachs Group Inc [*] | 1,38 % | 15.05.2024 | 198.121 | 0,02 |
| 4.800.000 | Grand City Properties SA [*] | 1,50 % | 29.12.2049 | 2.207.904 | 0,22 |
| 500.000 | Grand City Properties SA [*] | 5,90 % | 29.12.2049 | 286.809 | 0,03 |
| 2.000.000 | Grifols SA [*] | 1,63 % | 15.02.2025 | 1.960.912 | 0,20 |
| 200.000 | Gruenthal GmbH [*] | 3,63 % | 15.11.2026 | 197.900 | 0,02 |
| 1.000.000 | Grupo Antolin-Irausa SA [*] | 3,50 % | 30.04.2028 | 764.365 | 0,08 |

Ultra Short Term Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert EUR | % des Nettöver- mögens |
|--|-----------------------------------|---------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 79,48 % (31. Dezember 2022: 81,63 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Euro (Fortsetzung) | | | | | |
| 100.000 | Haleon Netherlands Capital BV* | 1,25 % | 29.03.2026 | 96.011 | 0,01 |
| 100.000 | Heathrow Funding Ltd* | 1,50 % | 12.10.2025 | 96.885 | 0,01 |
| 6.435.000 | Heimstaden Bostad AB* | 1,13 % | 21.01.2026 | 5.522.189 | 0,56 |
| 6.800.000 | Heimstaden Bostad AB* | 3,38 % | 29.12.2049 | 2.887.552 | 0,29 |
| 3.600.000 | Heimstaden Bostad Treasury BV* | 0,25 % | 13.10.2024 | 3.396.856 | 0,34 |
| 5.300.000 | Heimstaden Bostad Treasury BV* | 0,63 % | 24.07.2025 | 4.711.016 | 0,47 |
| 8.500.000 | Holcim Finance Luxembourg SA* | 1,50 % | 06.04.2025 | 8.282.471 | 0,83 |
| 2.000.000 | Holcim Finance Luxembourg SA* | 3,00 % | 29.12.2049 | 1.986.684 | 0,20 |
| 8.000.000 | HSBC Holdings Plc* | 0,31 % | 13.11.2026 | 7.543.416 | 0,76 |
| 2.500.000 | Iberdrola Finanzas SA* | 1,58 % | 29.12.2049 | 2.231.325 | 0,22 |
| 1.750.000 | Iceland Bondco Plc** | 9,50 % | 15.12.2027 | 1.753.500 | 0,18 |
| 200.000 | IHO Verwaltungs GmbH* | 8,75 % | 15.05.2028 | 218.368 | 0,02 |
| 600.000 | Iliad Holding SASU** | 5,13 % | 15.10.2026 | 599.948 | 0,06 |
| 200.000 | INEOS Finance Plc* | 2,88 % | 01.05.2026 | 194.291 | 0,02 |
| 6.500.000 | ING Groep NV* | 0,13 % | 29.11.2025 | 6.278.980 | 0,63 |
| 15.000.000 | Intesa Sanpaolo SpA** | 2,13 % | 26.05.2025 | 14.707.800 | 1,48 |
| 1.500.000 | Intesa Sanpaolo SpA* | 2,93 % | 14.10.2030 | 1.371.435 | 0,14 |
| 5.500.000 | Intesa Sanpaolo SpA** | 5,00 % | 08.03.2028 | 5.696.037 | 0,57 |
| 6.100.000 | Investec Bank Plc* | 1,25 % | 11.08.2026 | 5.730.377 | 0,58 |
| 8.376.000 | Islandsbanki HF* | 0,75 % | 25.03.2025 | 7.982.345 | 0,80 |
| 10.026.000 | Islandsbanki HF* | 7,38 % | 17.05.2026 | 10.564.216 | 1,06 |
| 650.000 | Italmatch Chemicals SpA* | 10,00 % | 06.02.2028 | 673.517 | 0,07 |
| 100.000 | Jaguar Land Rover Automotive Plc* | 4,50 % | 15.07.2028 | 97.957 | 0,01 |
| 3.600.000 | KBC Group NV* | 4,50 % | 06.06.2026 | 3.640.507 | 0,37 |
| 1.000.000 | Kleopatra Finco Sarl** | 4,25 % | 01.03.2026 | 829.038 | 0,08 |
| 4.500.000 | Landsbankinn HF* | 0,38 % | 23.05.2025 | 4.227.466 | 0,43 |
| 14.000.000 | Landsbankinn HF* | 0,75 % | 25.05.2026 | 12.750.220 | 1,28 |
| 3.040.000 | Landsbankinn HF* | 6,38 % | 12.03.2027 | 3.152.638 | 0,32 |
| 3.000.000 | LeasePlan Corp NV* | 0,25 % | 23.02.2026 | 2.796.849 | 0,28 |
| 1.700.000 | LeasePlan Corp NV* | 0,25 % | 07.09.2026 | 1.563.344 | 0,16 |
| 2.200.000 | Leasys SpA* | 4,38 % | 07.12.2024 | 2.204.868 | 0,22 |
| 5.000.000 | Lloyds Bank Plc* | 3,25 % | 02.02.2026 | 5.024.445 | 0,51 |
| 6.000.000 | Lloyds Banking Group Plc* | 0,50 % | 12.11.2025 | 5.828.982 | 0,59 |
| 6.000.000 | Lloyds Banking Group Plc* | 3,50 % | 01.04.2026 | 5.984.172 | 0,60 |
| 600.000 | Lorca Telecom Bondco SA* | 4,00 % | 18.09.2027 | 587.247 | 0,06 |
| 200.000 | Loxam SAS* | 4,50 % | 15.04.2027 | 190.736 | 0,02 |
| 800.000 | Loxam SAS* | 6,38 % | 15.05.2028 | 835.120 | 0,08 |
| 2.200.000 | Loxam SAS* | 6,38 % | 31.05.2029 | 2.284.634 | 0,23 |
| 380.000 | Maxeda DIY Holding BV** | 5,88 % | 01.10.2026 | 290.559 | 0,03 |
| 2.200.000 | Merck KGaA* | 1,63 % | 25.06.2079 | 2.146.084 | 0,22 |

Ultra Short Term Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert EUR | % des Nettöver- mögens |
|--|--------------------------------------|--------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 79,48 % (31. Dezember 2022: 81,63 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Euro (Fortsetzung) | | | | | |
| 3.700.000 | Mitsubishi UFJ Financial Group Inc* | 3,27 % | 19.09.2025 | 3.677.878 | 0,37 |
| 200.000 | MMS USA Holdings Inc* | 0,63 % | 13.06.2025 | 191.788 | 0,02 |
| 5.000.000 | Molson Coors Beverage Co* | 1,25 % | 15.07.2024 | 4.925.820 | 0,50 |
| 7.000.000 | Morgan Stanley* | 1,88 % | 27.04.2027 | 6.684.048 | 0,67 |
| 3.000.000 | Mylan Inc* | 2,13 % | 23.05.2025 | 2.929.866 | 0,29 |
| 1.200.000 | Nationwide Building Society* | 3,25 % | 05.09.2029 | 1.199.688 | 0,12 |
| 15.000.000 | NatWest Group Plc* | 1,75 % | 02.03.2026 | 14.610.420 | 1,47 |
| 2.000.000 | NGG Finance Plc* | 1,63 % | 05.12.2079 | 1.960.000 | 0,20 |
| 1.500.000 | Nordea Bank Abp* | 1,00 % | 27.06.2029 | 1.469.233 | 0,15 |
| 5.000.000 | OMV AG* | 2,88 % | 29.12.2049 | 4.980.535 | 0,50 |
| 150.000 | Ontex Group NV* | 3,50 % | 15.07.2026 | 145.088 | 0,01 |
| 2.000.000 | Orano SA* | 3,38 % | 23.04.2026 | 1.984.922 | 0,20 |
| 1.500.000 | Orsted AS* | 2,25 % | 29.12.2049 | 1.468.155 | 0,15 |
| 200.000 | Paprec Holding SA** | 6,50 % | 17.11.2027 | 214.221 | 0,02 |
| 500.000 | PCF GmbH* | 4,75 % | 15.04.2026 | 366.836 | 0,04 |
| 100.000 | PEU Finance Plc* | 7,25 % | 01.07.2028 | 103.185 | 0,01 |
| 2.000.000 | Pinnacle Bidco Plc* | 8,25 % | 11.10.2028 | 2.085.074 | 0,21 |
| 1.300.000 | Playtech Plc* | 4,25 % | 07.03.2026 | 1.276.462 | 0,13 |
| 100.000 | PLT VII Finance Sarl** | 4,63 % | 05.01.2026 | 99.690 | 0,01 |
| 4.100.000 | Prosus NV* | 2,78 % | 19.01.2034 | 3.206.688 | 0,33 |
| 1.800.000 | RCI Banque SA* | 1,63 % | 11.04.2025 | 1.757.516 | 0,18 |
| 1.500.000 | RCI Banque SA* | 1,75 % | 10.04.2026 | 1.442.214 | 0,15 |
| 200.000 | RCI Banque SA* | 2,00 % | 11.07.2024 | 197.917 | 0,02 |
| 1.700.000 | RCI Banque SA* | 4,63 % | 13.07.2026 | 1.739.612 | 0,18 |
| 2.100.000 | RCI Banque SA* | 4,63 % | 02.10.2026 | 2.155.492 | 0,22 |
| 3.000.000 | Repsol International Finance BV* | 2,50 % | 29.12.2049 | 2.813.914 | 0,28 |
| 200.000 | Rexel SA* | 5,25 % | 15.09.2030 | 208.966 | 0,02 |
| 200.000 | Ryanair DAC* | 0,88 % | 25.05.2026 | 189.041 | 0,02 |
| 3.380.000 | Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB* | 2,63 % | 29.12.2049 | 562.432 | 0,06 |
| 5.000.000 | Santander UK Group Holdings Plc* | 0,39 % | 28.02.2025 | 4.971.344 | 0,50 |
| 500.000 | Sappi Papier Holding GmbH* | 3,63 % | 15.03.2028 | 481.355 | 0,05 |
| 1.900.000 | SELP Finance Sarl* | 3,75 % | 10.08.2027 | 1.903.718 | 0,19 |
| 1.000.000 | Simon International Finance SCA* | 1,25 % | 13.05.2025 | 965.884 | 0,10 |
| 5.000.000 | Skipton Building Society* | 0,01 % | 22.09.2024 | 4.867.510 | 0,49 |
| 5.000.000 | Smurfit Kappa Acquisitions ULC* | 2,88 % | 15.01.2026 | 4.932.499 | 0,50 |
| 100.000 | Societe Generale SA* | 1,25 % | 15.02.2024 | 99.670 | 0,01 |
| 100.000 | SoftBank Group Corp* | 2,13 % | 06.07.2024 | 98.530 | 0,01 |
| 1.800.000 | SoftBank Group Corp* | 5,00 % | 15.04.2028 | 1.790.874 | 0,18 |
| 2.400.000 | Sogecap SA* | 6,50 % | 16.05.2044 | 2.596.243 | 0,26 |
| 4.640.000 | Southern Co* | 1,88 % | 15.09.2081 | 3.991.014 | 0,40 |

Ultra Short Term Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert EUR | % des Nettöver- mögens |
|--|--|--------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 79,48 % (31. Dezember 2022: 81,63 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Euro (Fortsetzung) | | | | | |
| 2.500.000 | SSE Plc [*] | 4,00 % | 29.12.2049 | 2.428.862 | 0,24 |
| 15.000.000 | Sumitomo Mitsui Banking Corp [*] | 3,60 % | 16.02.2026 | 15.094.079 | 1,52 |
| 2.000.000 | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd [*] | 4,09 % | 19.04.2028 | 2.073.690 | 0,21 |
| 262.000 | Summit Properties Ltd [*] | 2,00 % | 31.01.2025 | 246.968 | 0,02 |
| 4.900.000 | Swedbank AB [*] | 4,63 % | 30.05.2026 | 4.953.288 | 0,50 |
| 3.000.000 | Tapestry Inc [*] | 5,35 % | 27.11.2025 | 3.062.910 | 0,31 |
| 2.100.000 | TDC Net A/S [*] | 5,62 % | 06.02.2030 | 2.170.873 | 0,22 |
| 1.000.000 | Telecom Italia SpA [*] | 6,88 % | 15.02.2028 | 1.067.542 | 0,11 |
| 1.500.000 | Telefonica Europe BV [*] | 2,38 % | 29.12.2049 | 1.306.836 | 0,13 |
| 1.600.000 | Telefonica Europe BV [*] | 6,75 % | 29.12.2049 | 1.712.379 | 0,17 |
| 200.000 | Tereos Finance Groupe I SA ^{**} | 4,75 % | 30.04.2027 | 202.087 | 0,02 |
| 1.800.000 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV [*] | 1,63 % | 15.10.2028 | 1.539.065 | 0,15 |
| 6.500.000 | Thames Water Utilities Finance Plc [*] | 0,88 % | 31.01.2028 | 5.559.958 | 0,56 |
| 4.400.000 | Thames Water Utilities Finance Plc [*] | 4,00 % | 18.04.2027 | 4.259.249 | 0,43 |
| 3.000.000 | Toronto-Dominion Bank [*] | 1,71 % | 28.07.2025 | 2.934.225 | 0,30 |
| 2.000.000 | Toronto-Dominion Bank [*] | 2,55 % | 03.08.2027 | 1.958.772 | 0,20 |
| 700.000 | Toronto-Dominion Bank [*] | 3,77 % | 08.09.2026 | 714.497 | 0,07 |
| 3.800.000 | TotalEnergies SE [*] | 2,13 % | 29.12.2049 | 3.049.986 | 0,31 |
| 11.400.000 | Traton Finance Luxembourg SA [*] | 4,13 % | 18.01.2025 | 11.442.944 | 1,15 |
| 2.800.000 | Traton Finance Luxembourg SA [*] | 4,50 % | 23.11.2026 | 2.862.059 | 0,29 |
| 9.000.000 | UBS Group AG [*] | 0,25 % | 29.01.2026 | 8.629.047 | 0,87 |
| 8.300.000 | UBS Group AG [*] | 1,25 % | 17.07.2025 | 8.162.336 | 0,82 |
| 5.500.000 | UBS Group AG [*] | 2,13 % | 13.10.2026 | 5.348.173 | 0,54 |
| 700.000 | UBS Group AG [*] | 3,25 % | 02.04.2026 | 693.978 | 0,07 |
| 2.700.000 | Unibail-Rodamco-Westfield SE [*] | 7,25 % | 29.12.2049 | 2.709.842 | 0,27 |
| 6.000.000 | UniCredit SpA ^{**} | 1,20 % | 20.01.2026 | 5.825.976 | 0,59 |
| 5.000.000 | UniCredit SpA [*] | 1,25 % | 16.06.2026 | 4.828.460 | 0,49 |
| 5.896.000 | UniCredit SpA ^{**} | 2,20 % | 22.07.2027 | 5.699.273 | 0,57 |
| 2.200.000 | UniCredit SpA ^{**} | 5,85 % | 15.11.2027 | 2.332.161 | 0,23 |
| 200.000 | United Group BV ^{**} | 5,25 % | 01.02.2030 | 190.106 | 0,02 |
| 8.300.000 | US Bancorp [*] | 0,85 % | 07.06.2024 | 8.179.608 | 0,82 |
| 11.000.000 | Utah Acquisition Sub Inc [*] | 2,25 % | 22.11.2024 | 10.813.429 | 1,09 |
| 2.900.000 | Veolia Environnement SA [*] | 2,50 % | 29.12.2049 | 2.602.944 | 0,26 |
| 100.000 | Verisure Holding AB [*] | 7,13 % | 01.02.2028 | 105.497 | 0,01 |
| 1.600.000 | Virgin Money UK Plc [*] | 2,88 % | 24.06.2025 | 1.590.259 | 0,16 |
| 2.600.000 | Vodafone Group Plc [*] | 3,00 % | 27.08.2080 | 2.333.256 | 0,23 |
| 4.800.000 | Volkswagen Bank GmbH [*] | 2,50 % | 31.07.2026 | 4.680.863 | 0,47 |
| 1.500.000 | Volkswagen International Finance NV [*] | 3,75 % | 29.12.2049 | 1.410.305 | 0,14 |
| 1.600.000 | Volkswagen International Finance NV [*] | 3,88 % | 29.03.2026 | 1.612.791 | 0,16 |
| 1.000.000 | Volkswagen International Finance NV [*] | 3,88 % | 29.12.2049 | 919.327 | 0,09 |

Ultra Short Term Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert EUR | % des Nettöver- mögens |
|--|---|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 79,48 % (31. Dezember 2022: 81,63 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Euro (Fortsetzung) | | | | | |
| 2.200.000 | Volkswagen Leasing GmbH* | 4,50 % | 25.03.2026 | 2.249.425 | 0,23 |
| 2.000.000 | VZ Vendor Financing II BV* | 2,88 % | 15.01.2029 | 1.761.790 | 0,18 |
| 10.000.000 | Westpac Banking Corp* | 3,46 % | 04.04.2025 | 10.013.940 | 1,01 |
| 4.000.000 | Westpac Securities NZ Ltd* | 1,78 % | 14.01.2026 | 3.893.452 | 0,39 |
| 11.000.000 | Wizz Air Finance Co BV* | 1,00 % | 19.01.2026 | 10.142.231 | 1,02 |
| 100.000 | ZF Europe Finance BV* | 6,13 % | 13.03.2029 | 106.554 | 0,01 |
| 100.000 | ZF Finance GmbH* | 2,00 % | 06.05.2027 | 92.699 | 0,01 |
| Unternehmensanleihen insgesamt | | | | 789.167.617 | 79,48 |
| Staatsanleihen 7,59 % (31. Dezember 2022: 6,87 %) | | | | | |
| Euro | | | | | |
| 5.340.000 | Bank Gospodarstwa Krajowego* | 3,00 % | 30.05.2029 | 5.220.528 | 0,53 |
| 3.400.000 | Bank Gospodarstwa Krajowego* | 4,00 % | 08.09.2027 | 3.467.738 | 0,35 |
| 4.000.000 | Bulgaria Government International Bond* | 4,38 % | 13.05.2031 | 4.209.980 | 0,42 |
| 1.470.000 | Bulgaria Government International Bond* | 4,88 % | 13.05.2036 | 1.576.891 | 0,16 |
| 1.990.000 | European Stability Mechanism* | 3,00 % | 23.08.2033 | 2.057.906 | 0,21 |
| 1.700.000 | European Union* | 3,25 % | 04.07.2034 | 1.783.098 | 0,18 |
| 3.078.000 | European Union* | 3,38 % | 04.10.2038 | 3.235.628 | 0,33 |
| 1.320.000 | French Republic Government Bond OAT* | 1,25 % | 25.05.2034 | 1.161.335 | 0,12 |
| 6.839.000 | Hellenic Republic Government Bond* | 4,38 % | 18.07.2038 | 7.541.246 | 0,76 |
| 1.000.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro* | 0,25 % | 15.03.2028 | 896.644 | 0,09 |
| 6.807.130 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | 1,30 % | 15.05.2028 | 6.810.384 | 0,69 |
| 3.000.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | 1,75 % | 30.05.2024 | 2.975.286 | 0,30 |
| 2.628.580 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | 3,10 % | 15.09.2026 | 2.772.915 | 0,28 |
| 3.000.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro* | 3,40 % | 28.03.2025 | 3.008.286 | 0,30 |
| 750.000 | Italy Government International Bond* | 5,13 % | 31.07.2024 | 755.133 | 0,08 |
| 2.000.000 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT* | 3,50 % | 18.06.2038 | 2.099.017 | 0,21 |
| 2.147.000 | Romanian Government International Bond* | 1,75 % | 13.07.2030 | 1.740.133 | 0,17 |
| 2.900.000 | Romanian Government International Bond* | 2,12 % | 16.07.2031 | 2.319.893 | 0,23 |
| 4.900.000 | Romanian Government International Bond* | 3,62 % | 26.05.2030 | 4.517.517 | 0,45 |
| 1.000.000 | Romanian Government International Bond* | 3,88 % | 29.10.2035 | 855.370 | 0,09 |
| 6.520.000 | Romanian Government International Bond* | 6,38 % | 18.09.2033 | 6.908.044 | 0,69 |
| 2.200.000 | Romanian Government International Bond* | 6,63 % | 27.09.2029 | 2.357.172 | 0,24 |
| 1.800.000 | Slovenia Government Bond* | 1,50 % | 25.03.2035 | 1.523.448 | 0,15 |
| 1.170.000 | Slovenia Government Bond* | 3,63 % | 11.03.2033 | 1.239.027 | 0,12 |
| 1.850.000 | Spain Government Bond* | 3,15 % | 30.04.2033 | 1.883.063 | 0,19 |
| 2.356.000 | Spain Government Bond* | 3,55 % | 31.10.2033 | 2.470.365 | 0,25 |
| Staatsanleihen insgesamt | | | | 75.386.047 | 7,59 |
| Anlagen insgesamt | | | | 964.201.788 | 97,11 |

Ultra Short Term Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 0,03 % (31. Dezember 2022: 0,03 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn EUR | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|-------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> | | | | | | |
| 83.914 CHF | 88.753 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | 1.594 | 0,00 |
| 7.117.042 CHF | 7.481.264 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 9 | 181.422 | 0,02 |
| <i>Abgesicherte Klassen USD</i> | | | | | | |
| 3.670.762 € | 4.000.000 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 51.959 | 0,01 |
| 351.664 US\$ | 317.407 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 744 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | 235.719 | 0,03 |

Futures-Kontrakte 0,05 % (31. Dezember 2022: 1,14 %)

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Gewinn EUR | % des Nettovermögens |
|--|-------------------------------|-------------------------------|----------------------|
| 74 | Euro-BTP Future March 2024 | 230.880 | 0,02 |
| 733 | Euro-Schatz Future March 2024 | 278.540 | 0,03 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten [*] | | 509.420 | 0,05 |

Inflation-Swap-Kontrakte 0,05 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)

| Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei | Erhalt/(Zahlung) [#] | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Gewinn EUR | % des Nettovermögens |
|--|------------|-------------------------------|-------------------------------|-----------------|--------------------|-------------------------------|----------------------|
| EUR 30.000.000 | 15.11.2033 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 2,32 % | CPTFEMU | 531.378 | 0,05 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten[‡] | | | | | | 531.378 | 0,05 |

[#]Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

¹Zentral abgewickelter Swap.

| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | Zeitwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|--------------|----------------------|
| | 965.478.305 | 97,24 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,25 %) (31. Dezember 2022: (0,80 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust EUR | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> | | | | | | |
| 795.822 € | 756.969 CHF | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 15 | (19.184) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen USD</i> | | | | | | |
| 1.799.543 US\$ | 1.670.563 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 4 | (42.515) | (0,00) |
| 71.478.211 US\$ | 67.116.763 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 5 | (2.450.379) | (0,25) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | (2.512.078) | (0,25) |

Ultra Short Term Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Futures- Kontrakte (0,28 %) (31. Dezember 2022: (0,21 %))

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Verlust EUR | % des Nettovermögens |
|--|---|--------------------------------|----------------------|
| 428 | Euro-BOBL Put Option on Future February 2024, Strike Price EUR 118.00 | (83.676) | (0,01) |
| (549) | Euro-BOBL Future March 2024 | (466.180) | (0,05) |
| (355) | Euro-Bund Future March 2024 | (983.350) | (0,10) |
| (101) | Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2024 | (715.080) | (0,07) |
| (295) | Euro-OAT Future March 2024 | (535.400) | (0,05) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten * | | (2.783.686) | (0,28) |

Credit-Default-Swap-Kontrakte (0,22 %) (31. Dezember 2022: (0,07 %))

| Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei | Referenzverbindlichkeit | Zeitwert EUR | % des Nettovermögens |
|--|------------|-----------------------------|---|--------------------|----------------------|
| EUR 27.200.000 | 20.12.2028 | ICE Clear U.S. ¹ | Buying default protection on iTRAXX Europe Crossover S40.V1 | (2.179.454) | (0,22) |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt * | | | | (2.179.454) | (0,22) |

¹Zentral abgewickelter Swap.

Inflation-Swap-Kontrakte (0,03 %) (31. Dezember 2022: (0,00 %))

| Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei | Erhalt/(Zahlung) [#] | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Verlust EUR | % des Nettovermögens |
|---|------------|-------------------------------|-------------------------------|-----------------|--------------------|--------------------------------|----------------------|
| EUR 30.000.000 | 15.11.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 2,21 % | CPTFEMU | (293.227) | (0,03) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Inflation-Swap-Kontrakten[∞] | | | | | | (293.227) | (0,03) |

[#]Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

¹Zentral abgewickelter Swap.

Zinsswap-Kontrakte (0,03 %) (31. Dezember 2022: (0,21 %))

| Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei | Erhalt/(Zahlung) [#] | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Verlust EUR | % des Nettovermögens |
|--|------------|-------------------------------|-------------------------------|-----------------|--------------------|--------------------------------|----------------------|
| EUR 12.479.054 | 30.08.2032 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 2,22 % | 6M EURIBOR | (248.422) | (0,03) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten[∞] | | | | | | (248.422) | (0,03) |

[#]Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

¹Zentral abgewickelter Swap.

Ultra Short Term Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| | Zeitwert EUR | % des Netto- vermögens |
|---|--------------------|---------------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (8.016.867) | (0,81) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | 957.461.438 | 96,43 |
| Sonstiges Nettovermögen | 35.410.860 | 3,57 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | 992.872.298 | 100,00 |

| Portfolioanalyse | EUR | % des Gesamtver- mögens |
|---|--------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 795.099.743 | 79,37 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 169.102.045 | 16,88 |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | (2.274.266) | (0,23) |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap | (4.466.084) | (0,45) |
| Anlagen insgesamt | 957.461.438 | 95,57 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|--|------------------------------------|------------------|------------------------------|
| Aktien 4,75 % (31. Dezember 2022: 4,32 %) | | | |
| Euro | | | |
| 34 | Deutsche Lufthansa AG | 302 | 0,00 |
| 80.000 | Epic Acquisition Corp | 901.395 | 0,05 |
| 59.626 | Siemens Energy AG | 790.390 | 0,05 |
| Euro insgesamt | | 1.692.087 | 0,10 |
| Schweizer Franken | | | |
| 12.600 | ams-OSRAM AG | 31.648 | 0,00 |
| Schweizer Franken insgesamt | | 31.648 | 0,00 |
| US-Dollar | | | |
| 12.342 | AbbVie Inc | 1.912.640 | 0,12 |
| 2.394 | Advanced Energy Industries Inc | 260.754 | 0,02 |
| 5.507 | Advanced Micro Devices Inc | 811.787 | 0,05 |
| 501 | AeroVironment Inc | 63.146 | 0,00 |
| 1.363 | Align Technology Inc | 373.462 | 0,02 |
| 1.881 | Ameriprise Financial Inc | 714.460 | 0,04 |
| 14.279 | Apellis Pharmaceuticals Inc | 854.741 | 0,05 |
| 8.860 | Apple Inc | 1.705.816 | 0,10 |
| 400 | Applied Materials Inc | 64.828 | 0,00 |
| 3.136 | Autodesk Inc | 763.553 | 0,05 |
| 2.187 | Axon Enterprise Inc | 564.968 | 0,03 |
| 5.086 | Bath & Body Works Inc | 219.512 | 0,01 |
| 500 | Berkshire Hathaway Inc Class B | 178.330 | 0,01 |
| 14.707 | Best Buy Co Inc | 1.151.264 | 0,07 |
| 969 | BlackRock Inc Class A | 786.634 | 0,05 |
| 3.889 | Boyd Gaming Corp | 243.490 | 0,02 |
| 600 | Broadcom Inc | 669.750 | 0,04 |
| 12.532 | Cardinal Health Inc | 1.263.226 | 0,08 |
| 900 | CarMax Inc | 69.066 | 0,00 |
| 2.618 | CDW Corp | 595.124 | 0,04 |
| 2.334 | Cencora Inc | 479.357 | 0,03 |
| 1.110 | Charles Schwab Corp | 76.368 | 0,00 |
| 12.008 | Chemours Co | 378.732 | 0,02 |
| 277 | Chipotle Mexican Grill Inc Class A | 633.488 | 0,04 |
| 60.554 | Cleveland-Cliffs Inc | 1.236.513 | 0,08 |
| 12.990 | Commercial Metals Co | 650.020 | 0,04 |
| 18.056 | Confluent Inc Class A | 422.510 | 0,03 |
| 8.568 | CONMED Corp | 938.282 | 0,06 |
| 5.754 | Coty Inc Class A | 71.465 | 0,00 |
| 330 | CVS Health Corp | 26.057 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|--------------------------------------|---------------|----------------------|
| Aktien 4,75 % (31. Dezember 2022: 4,32 %) (Fortsetzung) | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | |
| 9.696 | Dave & Buster's Entertainment Inc | 522.130 | 0,03 |
| 45.110 | Devon Energy Corp | 2.043.483 | 0,13 |
| 6.165 | Dexcom Inc | 765.015 | 0,05 |
| 14.102 | Dick's Sporting Goods Inc | 2.072.289 | 0,13 |
| 15.294 | DISH Network Corp Class A Class A | 88.246 | 0,01 |
| 1.117 | Dollar Tree Inc | 158.670 | 0,01 |
| 880 | Domino's Pizza Inc | 362.762 | 0,02 |
| 2.174 | Eagle Materials Inc | 440.974 | 0,03 |
| 11.072 | EQT Corp | 428.043 | 0,03 |
| 275 | Etsy Inc | 22.289 | 0,00 |
| 330 | Fair Isaac Corp | 384.123 | 0,02 |
| 3.045 | FedEx Corp | 770.294 | 0,05 |
| 7 | Five Below Inc | 1.492 | 0,00 |
| 8.326 | Fortinet Inc | 487.321 | 0,03 |
| 21.284 | Freeport-McMoRan Inc | 906.060 | 0,06 |
| 9.474 | Guardant Health Inc | 256.272 | 0,02 |
| 1.875 | Halliburton Co | 67.781 | 0,00 |
| 3.132 | Hess Corp | 451.509 | 0,03 |
| 21.174 | HP Inc | 637.126 | 0,04 |
| 13.012 | ITT Inc | 1.552.592 | 0,10 |
| 18.777 | Kroger Co | 858.297 | 0,05 |
| 539 | Lam Research Corp | 422.177 | 0,03 |
| 5.899 | Louisiana-Pacific Corp | 417.826 | 0,03 |
| 1.174 | Lowe's Cos Inc | 261.274 | 0,02 |
| 665 | Lululemon Athletica Inc | 340.008 | 0,02 |
| 4.266 | LyondellBasell Industries NV Class A | 405.611 | 0,03 |
| 66.074 | Marathon Oil Corp | 1.596.348 | 0,10 |
| 3.927 | Meta Platforms Inc Class A | 1.390.001 | 0,09 |
| 1.512 | Microchip Technology Inc | 136.352 | 0,01 |
| 12.401 | Micron Technology Inc | 1.058.301 | 0,07 |
| 1.474 | Microsoft Corp | 554.283 | 0,03 |
| 7.700 | NetApp Inc | 678.832 | 0,04 |
| 2.397 | Netflix Inc | 1.167.051 | 0,07 |
| 4.010 | Neurocrine Biosciences Inc | 528.358 | 0,03 |
| 71.857 | NIO Inc ADR | 651.743 | 0,04 |
| 1.078 | Nucor Corp | 187.615 | 0,01 |
| 3.617 | NVIDIA Corp | 1.791.211 | 0,11 |
| 4.145 | ON Semiconductor Corp | 346.232 | 0,02 |
| 25.277 | ONEOK Inc | 1.774.951 | 0,11 |
| 914 | Palo Alto Networks Inc | 269.520 | 0,02 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|-----------------------------------|-------------------|----------------------|
| Aktien 4,75 % (31. Dezember 2022: 4,32 %) (Fortsetzung) | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | |
| 64.558 | PG&E Corp | 1.163.981 | 0,07 |
| 1.054 | Pioneer Natural Resources Co | 237.023 | 0,01 |
| 9.297 | Prudential Financial Inc | 964.192 | 0,06 |
| 10.850 | Qorvo Inc | 1.221.818 | 0,08 |
| 4.633 | Ralph Lauren Corp Class A | 668.079 | 0,04 |
| 17.660 | Range Resources Corp | 537.570 | 0,03 |
| 2.560 | RH | 746.189 | 0,05 |
| 101.707 | Sarepta Therapeutics Inc | 9.807.606 | 0,60 |
| 2.558 | Seagate Technology Holdings Plc | 218.376 | 0,01 |
| 16.916 | Semtech Corp | 370.630 | 0,02 |
| 1.140 | ServiceNow Inc | 805.399 | 0,05 |
| 1.275 | Sherwin-Williams Co | 397.672 | 0,02 |
| 401 | Sibanye Stillwater Ltd ADR | 2.177 | 0,00 |
| 2.197 | Signet Jewelers Ltd | 235.650 | 0,01 |
| 10.109 | Skechers USA Inc Class A | 630.195 | 0,04 |
| 3.149 | Skyworks Solutions Inc | 354.011 | 0,02 |
| 22.822 | Sunnova Energy International Inc | 348.035 | 0,02 |
| 9.050 | T Rowe Price Group Inc | 974.594 | 0,06 |
| 10.744 | Take-Two Interactive Software Inc | 1.729.247 | 0,11 |
| 21.470 | Targa Resources Corp | 1.865.099 | 0,11 |
| 3.819 | TD SYNNEX Corp | 410.963 | 0,03 |
| 8.784 | Tenet Healthcare Corp | 663.807 | 0,04 |
| 150 | Tesla Inc | 37.272 | 0,00 |
| 600 | Texas Instruments Inc | 102.276 | 0,01 |
| 3.263 | Thor Industries Inc | 385.850 | 0,02 |
| 10.380 | United States Steel Corp | 504.987 | 0,03 |
| 1.909 | Universal Display Corp | 365.115 | 0,02 |
| 4.242 | Valero Energy Corp | 551.460 | 0,03 |
| 3.503 | Voya Financial Inc | 255.579 | 0,02 |
| 960 | Walmart Inc | 151.344 | 0,01 |
| 186 | West Pharmaceutical Services Inc | 65.494 | 0,00 |
| 9.525 | Western Digital Corp | 498.824 | 0,03 |
| 1.446 | Wingstop Inc | 371.015 | 0,02 |
| 8.266 | Winnebago Industries Inc | 602.426 | 0,04 |
| 6.243 | Wolfspeed Inc | 271.633 | 0,02 |
| 7.141 | Wynn Resorts Ltd | 650.616 | 0,04 |
| 45.522 | ZTO Express Cayman Inc ADR | 968.708 | 0,06 |
| | US-Dollar insgesamt | 75.568.717 | 4,65 |
| | Aktien insgesamt * | 77.292.452 | 4,75 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|--------------------------|------------------|----------------------|
| Immobilienaktiengesellschaften 0,07 % (31. Dezember 2022: 0,16 %) | | | |
| US-Dollar | | | |
| 5.983 | Simon Property Group Inc | 853.415 | 0,05 |
| 13.140 | Tanger Inc | 364.241 | 0,02 |
| Immobilienaktiengesellschaften insgesamt * | | 1.217.656 | 0,07 |

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Fälligkeitsdatum | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|---|-------------------------------------|------------------|---------------|----------------------|
| Participatory Notes 0,00 % (31. Dezember 2022: 0,00 %) | | | | |
| Euro | | | | |
| 40.000 | Epic Acquisition Corp | 06.12.2026 | 2.209 | 0,00 |
| Euro insgesamt | | | 2.209 | 0,00 |
| Britisches Pfund | | | | |
| 50.000 | New Energy One Acquisition Corp Plc | 07.03.2027 | 14.342 | 0,00 |
| Britisches Pfund insgesamt | | | 14.342 | 0,00 |
| US-Dollar | | | | |
| 16.000 | Merrill Lynch BV | 15.03.2024 | 20.480 | 0,00 |
| 2.000 | Merrill Lynch International & Co CV | 19.01.2024 | 14 | 0,00 |
| US-Dollar insgesamt | | | 20.494 | 0,00 |
| Participatory Notes insgesamt ** | | | 37.045 | 0,00 |

| Kapitalbetrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeitsdatum | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|-----------------------------|--------|------------------|--------------------|----------------------|
| Schatzwechsel 43,48 % (31. Dezember 2022: 50,57 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 100.000.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 04.01.2024 | 99.970.968 | 6,14 |
| 110.000.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 09.01.2024 | 109.887.939 | 6,76 |
| 125.000.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 16.01.2024 | 124.744.670 | 7,67 |
| 125.000.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 01.02.2024 | 124.451.224 | 7,65 |
| 125.000.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 15.02.2024 | 124.200.055 | 7,64 |
| 125.000.000 | United States Treasury Bill | 0,00 % | 29.02.2024 | 123.940.845 | 7,62 |
| Schatzwechsel insgesamt ** | | | | 707.195.701 | 43,48 |
| Unternehmensanleihen 7,41 % (31. Dezember 2022: 5,16 %) | | | | | |
| Euro | | | | | |
| 500.000 | BNP Paribas SA** | 0,00 % | 03.01.2025 | 668.976 | 0,04 |
| Euro insgesamt | | | | 668.976 | 0,04 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 7,41 % (31. Dezember 2022: 5,16 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| Japanischer Yen | | | | | |
| 200.000.000 | Taiyo Yuden Co Ltd* | 0,00 % | 18.10.2030 | 1.549.865 | 0,09 |
| Japanischer Yen insgesamt | | | | 1.549.865 | 0,09 |
| US-Dollar | | | | | |
| 4.000.000 | 2001 Cat RE Ltd** | 18,00 % | 08.01.2024 | 3.992.600 | 0,25 |
| 3.000.000 | Alamo Re Ltd** | 13,84 % | 07.06.2026 | 3.062.925 | 0,19 |
| 3.000.000 | Atlas Capital Reinsurance 2020 DAC** | 13,64 % | 10.06.2024 | 3.021.975 | 0,19 |
| 2.250.000 | Atlas Capital Reinsurance 2022 Designated Activity Co** | 15,09 % | 06.06.2025 | 2.305.800 | 0,14 |
| 2.250.000 | Blue Halo Re Ltd* | 15,10 % | 24.02.2025 | 2.252.700 | 0,14 |
| 750.000 | Blue Ridge Re Ltd** | 8,00 % | 08.01.2027 | 750.375 | 0,05 |
| 3.000.000 | Bonanza RE Ltd** | 13,60 % | 08.01.2026 | 3.004.650 | 0,19 |
| 2.400.000 | Cape Lookout Re Ltd** | 10,70 % | 28.03.2025 | 2.375.160 | 0,15 |
| 4.500.000 | Cape Lookout Re Ltd** | 11,85 % | 28.04.2026 | 4.588.312 | 0,28 |
| 5.000.000 | Finca RE Ltd** | 13,34 % | 06.06.2025 | 5.107.625 | 0,31 |
| 3.750.000 | Gateway Re II Ltd** | 14,85 % | 27.04.2026 | 3.792.000 | 0,23 |
| 3.000.000 | Gateway Re Ltd** | 18,35 % | 24.02.2026 | 3.128.025 | 0,19 |
| 80.000.000 | Goldman Sachs International† | 0,00 % | 23.01.2024 | 8.000 | 0,00 |
| 1.500.000 | Herbie Re Ltd** | 14,65 % | 08.07.2024 | 1.519.800 | 0,09 |
| 2.000.000 | Herbie Re Ltd** | 15,07 % | 08.01.2025 | 1.973.000 | 0,12 |
| 1.500.000 | Herbie Re Ltd* | 23,65 % | 06.06.2025 | 1.087.500 | 0,07 |
| 5.125.000 | Hestia Re Ltd** | 14,72 % | 22.04.2025 | 4.838.000 | 0,30 |
| 3.000.000 | Hestia Re Ltd** | 15,10 % | 07.04.2026 | 3.069.675 | 0,19 |
| 3.800.000 | Kilimanjaro III Re Ltd** | 5,25 % | 25.06.2025 | 3.813.680 | 0,24 |
| 3.500.000 | L&F Co Ltd* | 2,50 % | 26.04.2030 | 2.405.900 | 0,15 |
| 4.750.000 | Lightning Re Series 2023-1** | 16,34 % | 31.03.2026 | 5.025.262 | 0,31 |
| 4.420.000 | Montoya Re Ltd* | 12,46 % | 07.04.2025 | 4.454.255 | 0,27 |
| 5.100.000 | Mystic Re IV Ltd* | 15,10 % | 08.01.2024 | 5.096.175 | 0,31 |
| 5.250.000 | Northshore Re II Ltd* | 11,10 % | 08.01.2024 | 5.240.156 | 0,32 |
| 1.500.000 | Pelican IV Re Ltd** | 5,86 % | 07.05.2024 | 26.363 | 0,00 |
| 3.000.000 | Purple Re Ltd** | 17,59 % | 24.04.2026 | 2.988.375 | 0,18 |
| 4.000.000 | Residential Reinsurance 2021 Ltd** | 7,85 % | 06.06.2025 | 3.826.400 | 0,24 |
| 3.185.000 | Residential Reinsurance 2021 Ltd** | 9,01 % | 06.06.2025 | 2.965.872 | 0,18 |
| 2.425.000 | Residential Reinsurance 2021 Ltd** | 10,86 % | 06.06.2025 | 2.133.636 | 0,13 |
| 1.500.000 | Residential Reinsurance 2021 Ltd* | 15,28 % | 06.06.2025 | 1.300.950 | 0,08 |
| 1.500.000 | Residential Reinsurance 2022 Ltd** | 10,67 % | 06.06.2026 | 1.343.100 | 0,08 |
| 3.000.000 | Residential Reinsurance 2022 Ltd** | 15,43 % | 06.12.2026 | 3.115.650 | 0,19 |
| 2.050.000 | Sanders Re III Ltd** | 11,60 % | 07.04.2027 | 2.089.514 | 0,13 |
| 3.000.000 | Sanders Re III Ltd** | 15,50 % | 07.04.2027 | 2.632.050 | 0,16 |
| 3.500.000 | Sanders Re III Ltd* | 17,11 % | 07.04.2026 | 2.756.950 | 0,17 |
| 3.250.000 | Sussex Capital UK Pcc Ltd** | 13,74 % | 08.01.2025 | 3.209.050 | 0,20 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|--|---------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| Unternehmensanleihen 7,41 % (31. Dezember 2022: 5,16 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 4.750.000 | Titania RE Ltd** | 17,60 % | 27.02.2026 | 5.093.188 | 0,31 |
| 4.250.000 | Topanga Re Ltd** | 8,66 % | 08.01.2026 | 3.945.488 | 0,24 |
| 2.000.000 | Ursa Re II Ltd** | 10,36 % | 16.06.2025 | 1.982.150 | 0,12 |
| 3.000.000 | Ursa Re II Ltd** | 12,36 % | 06.12.2025 | 3.077.700 | 0,19 |
| US-Dollar insgesamt | | | | 118.399.986 | 7,28 |
| Unternehmensanleihen insgesamt | | | | 120.618.827 | 7,41 |
| Staatsanleihen 2,40 % (31. Dezember 2022: 0,13 %) | | | | | |
| Polnischer Zloty | | | | | |
| 14.200.000 | Republic of Poland Government Bond | 1,75 % | 25.04.2032 | 2.810.381 | 0,17 |
| Polnischer Zloty insgesamt | | | | 2.810.381 | 0,17 |
| Südafrikanischer Rand | | | | | |
| 335.000.000 | Republic of South Africa Government Bond | 8,75 % | 31.01.2044 | 13.608.831 | 0,84 |
| Südafrikanischer Rand insgesamt | | | | 13.608.831 | 0,84 |
| US-Dollar | | | | | |
| 8.585.000 | Ukraine Government International Bond | 7,75 % | 01.08.2041 | 3.872.754 | 0,24 |
| 14.400.000 | Ukraine Government International Bond | 7,38 % | 25.09.2034 | 3.420.720 | 0,21 |
| 55.000.000 | Ukraine Government International Bond | 7,75 % | 01.09.2029 | 15.251.885 | 0,94 |
| US-Dollar insgesamt | | | | 22.545.359 | 1,39 |
| Staatsanleihen insgesamt * | | | | 38.964.571 | 2,40 |
| Anlagen insgesamt | | | | 945.326.252 | 58,11 |

Devisenterminkontrakte 5,65 % (31. Dezember 2022: 6,78 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeits- datum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettöver- mögens |
|-----------------------|------------------------|-----------------------|--------------------------------|-----------|-----------------------------------|------------------------------|
| 110.000 AUD | 74.024 US\$ | 20.03.2024 | Barclays Bank Plc | 1 | 1.211 | 0,00 |
| 1.450.000 AUD | 983.861 US\$ | 20.03.2024 | BNP Paribas | 6 | 7.866 | 0,00 |
| 3.710.000 AUD | 2.481.670 US\$ | 20.03.2024 | Citibank NA | 12 | 55.785 | 0,00 |
| 540.000 AUD | 366.094 US\$ | 20.03.2024 | Deutsche Bank AG | 7 | 3.239 | 0,00 |
| 31.386.088 AUD | 16.625.000 € | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 7 | 226.804 | 0,01 |
| 43.514.397 AUD | 29.398.983 US\$ | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 10 | 299.804 | 0,02 |
| 222.457 AUD | 239.131 NZD | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 418 | 0,00 |
| 23.200.000 AUD | 20.794.426 CAD | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 3 | 62.276 | 0,00 |
| 27.802.893 AUD | 17.000.000 € | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 5 | 191.536 | 0,02 |
| 42.000.000 AUD | 4.005.830.346 ¥ | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | 219.655 | 0,02 |
| 520.000 AUD | 349.842 US\$ | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 6 | 5.813 | 0,00 |
| 4.920.000 AUD | 463.518.612 ¥ | 21.03.2024 | UBS AG | 2 | 36.656 | 0,01 |
| 470.000 AUD | 317.425 US\$ | 20.03.2024 | UBS AG | 7 | 4.029 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 5,65 % (31. Dezember 2022: 6,78 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 16.990.000 BRL | 3.400.335 US\$ | 20.03.2024 | BNP Paribas | 2 | 71.690 | 0,00 |
| 680.000 BRL | 138.780 US\$ | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | 182 | 0,00 |
| 2.420.000 BRL | 493.053 US\$ | 20.03.2024 | Deutsche Bank AG | 3 | 1.491 | 0,00 |
| 128.124.582 BRL | 26.201.115 US\$ | 03.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 91 | 174.992 | 0,00 |
| 19.468.110 BRL | 4.000.000 US\$ | 02.02.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 804 | 0,00 |
| 1.160.000 BRL | 235.976 US\$ | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 3 | 1.078 | 0,00 |
| 220.000 CAD | 164.978 US\$ | 20.03.2024 | Barclays Bank Plc | 2 | 2.044 | 0,00 |
| 1.530.000 CAD | 1.153.892 US\$ | 20.03.2024 | BNP Paribas | 6 | 7.669 | 0,00 |
| 310.000 CAD | 232.963 US\$ | 20.03.2024 | Citibank NA | 3 | 2.386 | 0,00 |
| 1.380.000 CAD | 1.032.284 US\$ | 20.03.2024 | Deutsche Bank AG | 9 | 15.399 | 0,00 |
| 11.336.278 CAD | 7.750.000 € | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 6 | 34.839 | 0,01 |
| 157.200.000 CAD | 116.829.086 US\$ | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 9 | 2.401.558 | 0,14 |
| 541.678 CAD | 600.000 AUD | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 1.340 | 0,00 |
| 5.070.000 CAD | 3.829.810 US\$ | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 27 | 19.278 | 0,00 |
| 2.440.000 CAD | 1.841.300 US\$ | 20.03.2024 | UBS AG | 16 | 11.124 | 0,00 |
| 6.330.000 CHF | 7.296.068 US\$ | 20.03.2024 | Citibank NA | 5 | 285.206 | 0,02 |
| 100.000 CHF | 117.172 US\$ | 20.03.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | 2.595 | 0,00 |
| 8.000.000 CHF | 9.170.790 US\$ | 05.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 336.326 | 0,02 |
| 40.975.456 CHF | 43.375.000 € | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 5 | 793.206 | 0,05 |
| 10.573.512 CHF | 9.625.000 £ | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 3 | 301.593 | 0,02 |
| 14.750.000 CHF | 2.449.110.610 ¥ | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | 146.668 | 0,01 |
| 25.875.000 CHF | 29.879.124 US\$ | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 7 | 886.503 | 0,05 |
| 770.000 CHF | 894.843 US\$ | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 11 | 27.367 | 0,00 |
| 180.000 CHF | 210.633 US\$ | 20.03.2024 | UBS AG | 3 | 4.947 | 0,00 |
| 46.840.000 CLP | 53.092 US\$ | 20.03.2024 | Citibank NA | 2 | 330 | 0,00 |
| 87.765.781 CLP | 100.000 US\$ | 12.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 470 | 0,00 |
| 612.377.138 CLP | 700.000 US\$ | 11.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | 1.075 | 0,00 |
| 530.403.469 CLP | 600.000 US\$ | 04.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 7.353 | 0,00 |
| 27.370.000 CLP | 30.843 US\$ | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 372 | 0,00 |
| 38.486.815 CNY | 5.400.000 US\$ | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 7.806 | 0,00 |
| 811.037.200 COP | 200.000 US\$ | 05.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | 9.272 | 0,00 |
| 1.617.897.515 COP | 400.000 US\$ | 09.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 3 | 17.142 | 0,00 |
| 1.206.180.900 COP | 300.000 US\$ | 11.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 10.856 | 0,00 |
| 395.781.000 COP | 100.000 US\$ | 12.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 1.977 | 0,00 |
| 395.513.913 COP | 100.000 US\$ | 16.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 1.813 | 0,00 |
| 398.637.907 COP | 100.000 US\$ | 18.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 2.570 | 0,00 |
| 2.786.762.696 COP | 700.000 US\$ | 19.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | 16.871 | 0,00 |
| 10.240.000 CZK | 455.445 US\$ | 20.03.2024 | BNP Paribas | 4 | 1.788 | 0,00 |
| 2.480.000 CZK | 110.725 US\$ | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | 11 | 0,00 |
| 6.748.069 CZK | 300.000 US\$ | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | 1.870 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 5,65 % (31. Dezember 2022: 6,78 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 4.340.000 CZK | 193.300 US\$ | 20.03.2024 | Royal Bank of Scotland | 1 | 489 | 0,00 |
| 2.870.000 CZK | 127.754 US\$ | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 396 | 0,00 |
| 3.030.000 € | 3.307.826 US\$ | 20.03.2024 | Barclays Bank Plc | 13 | 49.771 | 0,00 |
| 380.000 € | 13.189.779 TRY | 20.03.2024 | Barclays Bank Plc | 3 | 5.764 | 0,00 |
| 553.716 € | 2.410.000 PLN | 20.03.2024 | BNP Paribas | 2 | 1.350 | 0,00 |
| 80.000 € | 88.042 US\$ | 20.03.2024 | BNP Paribas | 1 | 607 | 0,00 |
| 2.500.000 € | 85.742.344 TRY | 20.03.2024 | Citibank NA | 3 | 70.427 | 0,00 |
| 417.644 € | 1.820.000 PLN | 20.03.2024 | Citibank NA | 5 | 448 | 0,00 |
| 120.000 € | 132.002 US\$ | 20.03.2024 | Deutsche Bank AG | 2 | 973 | 0,00 |
| 158.501 € | 690.000 PLN | 20.03.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | 352 | 0,00 |
| 47.000.000 € | 51.523.515 US\$ | 05.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 398.999 | 0,03 |
| 1.000.000 € | 1.061.000 US\$ | 31.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 44.976 | 0,00 |
| 200.000 € | 865.362 PLN | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | 939 | 0,00 |
| 20.000.000 € | 17.184.419 £ | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 6 | 191.381 | 0,01 |
| 54.875.000 € | 59.828.145 US\$ | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 5 | 805.742 | 0,06 |
| 700.000 € | 108.520.895 ¥ | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 2.851 | 0,00 |
| 1.250.000 € | 2.022.188 AUD | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 1.029 | 0,00 |
| 80.000 € | 2.755.413 TRY | 20.03.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | 1.886 | 0,00 |
| 1.100.000 € | 420.536.171 HUF | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 1.264 | 0,00 |
| 50.516 € | 220.000 PLN | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 89 | 0,00 |
| 1.600.000 € | 1.766.944 US\$ | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 14 | 6.046 | 0,00 |
| 1.310.781 € | 5.700.000 PLN | 20.03.2024 | UBS AG | 11 | 4.482 | 0,00 |
| 5.620.000 £ | 7.066.522 US\$ | 20.03.2024 | Barclays Bank Plc | 3 | 100.611 | 0,01 |
| 40.000 £ | 50.813 US\$ | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | 198 | 0,00 |
| 30.000 £ | 37.823 US\$ | 20.03.2024 | Deutsche Bank AG | 2 | 435 | 0,00 |
| 7.000.000 £ | 8.813.316 US\$ | 05.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 110.383 | 0,01 |
| 38.079.545 £ | 48.243.833 US\$ | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | 301.813 | 0,02 |
| 250.000 £ | 267.840 CHF | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 247 | 0,00 |
| 60.000 £ | 76.209 US\$ | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 2 | 308 | 0,00 |
| 170.000.000 HKD | 21.773.935 US\$ | 26.01.2024 | Citibank NA | 1 | 9.294 | 0,00 |
| 1.161.570.000 HUF | 3.279.001 US\$ | 20.03.2024 | BNP Paribas | 8 | 49.210 | 0,00 |
| 66.610.000 HUF | 187.747 US\$ | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | 3.108 | 0,00 |
| 124.370.000 HUF | 355.254 US\$ | 20.03.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | 1.099 | 0,00 |
| 66.640.000 HUF | 187.799 US\$ | 20.03.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 3.143 | 0,00 |
| 4.576.324.067 HUF | 13.000.000 US\$ | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 5 | 212.806 | 0,01 |
| 422.209.370 HUF | 1.100.000 € | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 3.567 | 0,00 |
| 21.770.000 HUF | 61.577 US\$ | 20.03.2024 | UBS AG | 1 | 800 | 0,00 |
| 1.930.000 ILS | 534.294 US\$ | 20.03.2024 | Barclays Bank Plc | 5 | 2.928 | 0,00 |
| 2.100.000 ILS | 569.065 US\$ | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | 15.478 | 0,00 |
| 550.000 ILS | 151.108 US\$ | 20.03.2024 | Deutsche Bank AG | 2 | 1.987 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 5,65 % (31. Dezember 2022: 6,78 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 2.915.159 ILS | 800.000 US\$ | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 3 | 9.620 | 0,00 |
| 560.000 ILS | 152.748 US\$ | 20.03.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | 3.131 | 0,00 |
| 1.120.000 ILS | 306.471 US\$ | 20.03.2024 | UBS AG | 3 | 5.286 | 0,00 |
| 212.670.000 INR | 2.545.337 US\$ | 20.03.2024 | BNP Paribas | 8 | 1.323 | 0,00 |
| 933.504.162 INR | 11.198.376 US\$ | 08.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | 16.764 | 0,00 |
| 2.399.132.985 INR | 28.815.070 US\$ | 11.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 3 | 3.781 | 0,00 |
| 283.052.869 INR | 3.400.000 US\$ | 05.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | 1.151 | 0,00 |
| 267.004.386 INR | 3.205.724 US\$ | 04.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 2.761 | 0,00 |
| 2.090.000 INR | 24.995 US\$ | 20.03.2024 | Société Générale | 1 | 32 | 0,00 |
| 23.220.000 ¥ | 165.271 US\$ | 21.03.2024 | Barclays Bank Plc | 4 | 1.470 | 0,00 |
| 65.018.500 ¥ | 680.000 AUD | 21.03.2024 | Citibank NA | 8 | 1.792 | 0,00 |
| 94.960.000 ¥ | 678.746 US\$ | 21.03.2024 | Citibank NA | 10 | 3.149 | 0,00 |
| 30.630.000 ¥ | 218.789 US\$ | 21.03.2024 | Deutsche Bank AG | 5 | 1.163 | 0,00 |
| 6.614.505.471 ¥ | 36.625.000 £ | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 5 | 278.526 | 0,02 |
| 42.056.378 ¥ | 250.000 CHF | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 1.392 | 0,00 |
| 6.200.000.000 ¥ | 43.263.063 US\$ | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 3 | 763.367 | 0,05 |
| 35.942.950 ¥ | 400.000 NZD | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | 1.965 | 0,00 |
| 1.427.421.416 ¥ | 14.800.000 AUD | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | 35.100 | 0,01 |
| 43.180.452 ¥ | 400.000 CAD | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 3.240 | 0,00 |
| 379.146.535 ¥ | 2.400.000 € | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 4 | 40.465 | 0,01 |
| 15.409.276 ¥ | 160.000 AUD | 21.03.2024 | Royal Bank of Scotland | 3 | 1.217 | 0,00 |
| 76.050.000 ¥ | 541.386 US\$ | 21.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 12 | 4.718 | 0,00 |
| 19.112.619 ¥ | 200.000 AUD | 21.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 4 | 451 | 0,00 |
| 37.173.609 ¥ | 390.000 AUD | 21.03.2024 | UBS AG | 3 | 192 | 0,00 |
| 96.110.000 KRW | 74.290 US\$ | 20.03.2024 | Barclays Bank Plc | 1 | 169 | 0,00 |
| 206.850.000 KRW | 159.203 US\$ | 20.03.2024 | Citibank NA | 2 | 1.049 | 0,00 |
| 129.643.368 KRW | 100.000 US\$ | 22.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 69 | 0,00 |
| 779.876.875 KRW | 600.000 US\$ | 11.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 1.456 | 0,00 |
| 1.957.120.424 KRW | 1.500.000 US\$ | 12.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 10 | 9.485 | 0,00 |
| 4.478.004.000 KRW | 3.400.000 US\$ | 16.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 54.864 | 0,00 |
| 5.098.328.212 KRW | 3.900.000 US\$ | 04.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | 54.755 | 0,00 |
| 1.163.011.300 KRW | 900.000 US\$ | 05.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 1.260 | 0,00 |
| 129.752.468 KRW | 100.000 US\$ | 29.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 208 | 0,00 |
| 259.876.958 KRW | 200.000 US\$ | 08.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 798 | 0,00 |
| 1.299.010.000 KRW | 1.000.000 US\$ | 19.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 2.445 | 0,00 |
| 149.040.000 KRW | 114.390 US\$ | 20.03.2024 | UBS AG | 1 | 1.075 | 0,00 |
| 55.730.000 MXN | 3.159.084 US\$ | 20.03.2024 | Barclays Bank Plc | 2 | 90.499 | 0,00 |
| 10.670.000 MXN | 609.152 US\$ | 20.03.2024 | Citibank NA | 2 | 13.009 | 0,00 |
| 15.140.000 MXN | 875.162 US\$ | 20.03.2024 | Deutsche Bank AG | 4 | 7.643 | 0,00 |
| 2.140.000 MXN | 123.312 US\$ | 20.03.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | 1.470 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 5,65 % (31. Dezember 2022: 6,78 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 476.821.918 MXN | 27.232.390 US\$ | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 6 | 893.886 | 0,06 |
| 1.020.000 MXN | 58.434 US\$ | 20.03.2024 | UBS AG | 1 | 1.041 | 0,00 |
| 11.740.000 NOK | 1.127.374 US\$ | 20.03.2024 | BNP Paribas | 10 | 30.633 | 0,00 |
| 1.530.000 NOK | 148.667 US\$ | 20.03.2024 | Citibank NA | 3 | 2.250 | 0,00 |
| 6.560.000 NOK | 626.669 US\$ | 20.03.2024 | Deutsche Bank AG | 5 | 20.394 | 0,00 |
| 198.194.241 NOK | 17.250.000 € | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 458.778 | 0,03 |
| 171.112.767 NOK | 16.300.000 US\$ | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 4 | 551.979 | 0,03 |
| 55.745.979 NOK | 54.473.577 SEK | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 83.347 | 0,01 |
| 14.670.000 NOK | 1.404.250 US\$ | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 15 | 42.767 | 0,00 |
| 3.570.000 NOK | 342.995 US\$ | 20.03.2024 | UBS AG | 5 | 9.142 | 0,00 |
| 1.320.000 NZD | 830.734 US\$ | 20.03.2024 | Barclays Bank Plc | 3 | 5.177 | 0,00 |
| 260.000 NZD | 162.606 US\$ | 20.03.2024 | Citibank NA | 3 | 2.044 | 0,00 |
| 216.051 NZD | 200.000 AUD | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 296 | 0,00 |
| 29.100.000 NZD | 18.086.797 US\$ | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 4 | 338.375 | 0,03 |
| 29.800.000 NZD | 2.654.040.168 ¥ | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | 21.953 | 0,01 |
| 80.000 NZD | 49.892 US\$ | 20.03.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 769 | 0,00 |
| 410.000 NZD | 257.798 US\$ | 20.03.2024 | Royal Bank of Scotland | 4 | 1.841 | 0,00 |
| 1.210.000 NZD | 762.654 US\$ | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 10 | 3.598 | 0,00 |
| 3.000.000 NZD | 1.850.177 US\$ | 20.03.2024 | UBS AG | 8 | 49.619 | 0,00 |
| 6.610.000 PHP | 118.932 US\$ | 20.03.2024 | Barclays Bank Plc | 1 | 390 | 0,00 |
| 166.540.000 PHP | 2.993.310 US\$ | 20.03.2024 | BNP Paribas | 5 | 13.032 | 0,00 |
| 337.860.000 PHP | 6.051.298 US\$ | 20.03.2024 | UBS AG | 5 | 47.673 | 0,00 |
| 33.100.000 PLN | 7.583.573 € | 20.03.2024 | BNP Paribas | 2 | 5.184 | 0,01 |
| 18.250.000 PLN | 4.537.286 US\$ | 20.03.2024 | BNP Paribas | 3 | 98.919 | 0,01 |
| 350.000 PLN | 88.332 US\$ | 20.03.2024 | Citibank NA | 3 | 582 | 0,00 |
| 120.000 PLN | 30.333 US\$ | 20.03.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | 152 | 0,00 |
| 77.931.931 PLN | 19.500.000 US\$ | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 3 | 317.155 | 0,02 |
| 20.000 PLN | 5.056 US\$ | 20.03.2024 | UBS AG | 1 | 25 | 0,00 |
| 280.000 SEK | 26.882 US\$ | 20.03.2024 | BNP Paribas | 1 | 987 | 0,00 |
| 45.230.000 SEK | 4.349.903 US\$ | 20.03.2024 | Citibank NA | 4 | 151.886 | 0,01 |
| 3.073.512 SEK | 300.000 US\$ | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 5.061 | 0,00 |
| 1.408.081 SEK | 125.000 € | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 1.641 | 0,00 |
| 740.000 SEK | 73.103 US\$ | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 550 | 0,00 |
| 1.040.000 SGD | 786.526 US\$ | 20.03.2024 | BNP Paribas | 2 | 4.718 | 0,00 |
| 12.840.000 SGD | 9.656.053 US\$ | 20.03.2024 | Citibank NA | 9 | 112.775 | 0,00 |
| 55.592.480 SGD | 41.600.000 US\$ | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 3 | 558.025 | 0,04 |
| 400.000 SGD | 301.483 US\$ | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 2.842 | 0,00 |
| 200.000 SGD | 151.209 US\$ | 20.03.2024 | UBS AG | 1 | 953 | 0,00 |
| 4.340.000 THB | 125.999 US\$ | 20.03.2024 | Barclays Bank Plc | 3 | 2.007 | 0,00 |
| 25.840.000 THB | 747.660 US\$ | 20.03.2024 | BNP Paribas | 4 | 14.484 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 5,65 % (31. Dezember 2022: 6,78 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|-------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 56.980.000 THB | 1.645.180 US\$ | 20.03.2024 | JPMorgan Chase Bank | 5 | 35.432 | 0,00 |
| 44.200.000 THB | 1.277.608 US\$ | 20.03.2024 | Royal Bank of Scotland | 2 | 26.060 | 0,00 |
| 16.936.071 TRY | 480.000 € | 20.03.2024 | Citibank NA | 9 | 1.389 | 0,00 |
| 5.951.550 TRY | 200.000 US\$ | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | 346 | 0,00 |
| 1.112.037.500 TWD | 35.500.000 US\$ | 02.02.2024 | Bank of America Merrill Lynch | 1 | 1.121.139 | 0,07 |
| 667.861.500 TWD | 21.300.000 US\$ | 02.02.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 693.727 | 0,04 |
| 1.113.280.000 TWD | 35.500.000 US\$ | 15.02.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | 1.228.096 | 0,08 |
| 444.957.000 TWD | 14.200.000 US\$ | 05.02.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | 459.214 | 0,03 |
| 1.335.936.000 TWD | 42.600.000 US\$ | 16.02.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 1.479.823 | 0,09 |
| 232.236.376 TWD | 7.393.587 US\$ | 04.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | 180.615 | 0,01 |
| 3.117.186 TWD | 100.000 US\$ | 08.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 2.051 | 0,00 |
| 24.857.066 TWD | 800.000 US\$ | 26.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 6 | 17.586 | 0,00 |
| 245.925.901 TWD | 7.900.000 US\$ | 16.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 174.845 | 0,01 |
| 156.318.680 TWD | 5.040.469 US\$ | 18.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 9 | 93.953 | 0,00 |
| 3.106.386 TWD | 100.000 US\$ | 22.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 2.103 | 0,00 |
| 6.123.652 TWD | 200.000 US\$ | 29.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 1.521 | 0,00 |
| 112.999.312 TWD | 3.700.000 US\$ | 31.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 4 | 19.951 | 0,00 |
| 6.217.167 TWD | 200.000 US\$ | 12.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | 3.996 | 0,00 |
| 6.231.574 TWD | 200.000 US\$ | 11.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 4.433 | 0,00 |
| 96.388 US\$ | 80.000 CHF | 20.03.2024 | Barclays Bank Plc | 2 | 573 | 0,00 |
| 306.145 US\$ | 240.000 € | 20.03.2024 | Barclays Bank Plc | 2 | 75 | 0,00 |
| 165.496 US\$ | 650.000 PLN | 20.03.2024 | BNP Paribas | 1 | 371 | 0,00 |
| 587.654 US\$ | 49.070.000 INR | 20.03.2024 | BNP Paribas | 2 | 56 | 0,00 |
| 77.374 US\$ | 2.440.000 TRY | 20.03.2024 | BNP Paribas | 3 | 543 | 0,00 |
| 177.238 US\$ | 61.690.000 HUF | 20.03.2024 | BNP Paribas | 1 | 479 | 0,00 |
| 503.194 US\$ | 5.000.000 SEK | 20.03.2024 | BNP Paribas | 5 | 5.539 | 0,00 |
| 685.361 US\$ | 900.000 SGD | 20.03.2024 | Citibank NA | 3 | 631 | 0,00 |
| 109.850 US\$ | 9.170.000 INR | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | 42 | 0,00 |
| 84.247 US\$ | 70.000 CHF | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | 410 | 0,00 |
| 185.529 US\$ | 730.000 PLN | 20.03.2024 | Deutsche Bank AG | 5 | 80 | 0,00 |
| 3.550.000 US\$ | 2.857.750.000 NGN | 22.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 610.278 | 0,04 |
| 14.440.400 US\$ | 13.000.000 € | 02.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 79.948 | 0,01 |
| 320.411 US\$ | 2.500.000 HKD | 05.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 237 | 0,00 |
| 1.162.917 US\$ | 1.700.000 AUD | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 2.659 | 0,00 |
| 500.000 US\$ | 432.531.782 CLP | 12.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | 4.858 | 0,00 |
| 3.550.000 US\$ | 2.864.850.000 NGN | 22.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 602.974 | 0,04 |
| 600.000 US\$ | 522.624.715 CLP | 04.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 1.554 | 0,00 |
| 500.000 US\$ | 14.823.688 TRY | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 4 | 995 | 0,00 |
| 148.647 US\$ | 125.000 CHF | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 21 | 0,00 |
| 7.100.000 US\$ | 5.754.550.000 NGN | 19.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | 1.065.458 | 0,06 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 5,65 % (31. Dezember 2022: 6,78 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 24.183.739 US\$ | 2.009.451.451 INR | 22.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 28 | 57.736 | 0,00 |
| 100.000 US\$ | 8.331.131 INR | 29.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 6 | 0,00 |
| 800.000 US\$ | 687.624.592 CLP | 08.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | 12.684 | 0,00 |
| 1.244.391 US\$ | 1.125.000 € | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 1.327 | 0,00 |
| 2.689.560 US\$ | 81.553.858 TWD | 05.02.2024 | JPMorgan Chase Bank | 6 | 2.748 | 0,00 |
| 1.300.000 US\$ | 6.315.967 BRL | 02.02.2024 | JPMorgan Chase Bank | 7 | 2.034 | 0,00 |
| 768.213 US\$ | 13.000.000 MXN | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | 1.383 | 0,00 |
| 28.435.431 US\$ | 2.369.397.787 INR | 02.02.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | 1.861 | 0,00 |
| 900.000 US\$ | 1.162.602.000 KRW | 12.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 3.310 | 0,00 |
| 100.000 US\$ | 390.114 PLN | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 799 | 0,00 |
| 4.800.000 US\$ | 23.262.378 BRL | 03.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 5 | 11.137 | 0,00 |
| 300.000 US\$ | 3.033.679 NOK | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 1.229 | 0,00 |
| 6.079.639 US\$ | 505.695.090 INR | 19.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | 7.313 | 0,00 |
| 7.400.000 US\$ | 9.555.755.081 KRW | 19.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 12 | 25.835 | 0,00 |
| 400.000 US\$ | 345.532.000 CLP | 22.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 4.758 | 0,00 |
| 800.000 US\$ | 695.312.008 CLP | 18.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | 4.410 | 0,00 |
| 500.000 US\$ | 644.431.663 KRW | 04.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | 117 | 0,00 |
| 14.400.000 US\$ | 577.440.000 EGP | 20.03.2024 | Morgan Stanley | 1 | 1.237.039 | 0,08 |
| 754.046 US\$ | 590.000 £ | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 5 | 1.626 | 0,00 |
| 373.240 US\$ | 310.000 CHF | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 7 | 1.962 | 0,00 |
| 388.270 US\$ | 350.000 € | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 7 | 427 | 0,00 |
| 12.923 US\$ | 410.000 TRY | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 12 | 0,00 |
| 31.717 US\$ | 50.000 NZD | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 54 | 0,00 |
| 218.911 US\$ | 4.900.000 CZK | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 117 | 0,00 |
| 34.276 US\$ | 50.000 AUD | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 79 | 0,00 |
| 361.988 US\$ | 1.420.000 PLN | 20.03.2024 | UBS AG | 5 | 1.252 | 0,00 |
| 139.869 US\$ | 11.680.000 INR | 20.03.2024 | UBS AG | 1 | 5 | 0,00 |
| 180.663 US\$ | 1.810.000 SEK | 20.03.2024 | UBS AG | 3 | 512 | 0,00 |
| 2.615.425 US\$ | 82.620.000 TRY | 20.03.2024 | UBS AG | 2 | 13.875 | 0,00 |
| 7.210.000 ZAR | 385.521 US\$ | 20.03.2024 | Barclays Bank Plc | 3 | 6.068 | 0,00 |
| 3.940.000 ZAR | 213.011 US\$ | 20.03.2024 | Deutsche Bank AG | 3 | 978 | 0,00 |
| 24.132.477 ZAR | 1.300.000 US\$ | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 5 | 18.860 | 0,00 |
| 3.430.000 ZAR | 185.109 US\$ | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 3 | 1.180 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> | | | | | | |
| 2.811.012 CHF | 3.140.384 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 204.947 | 0,01 |
| 71.792 CHF | 80.583 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 4 | 4.856 | 0,00 |
| 2.970.447 CHF | 3.323.131 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 13 | 211.938 | 0,02 |
| 15.708 US\$ | 13.185 CHF | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | 16 | 0,00 |
| 9.655 US\$ | 8.063 CHF | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | 59 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 5,65 % (31. Dezember 2022: 6,78 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 450.774 € | 480.564 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | 17.693 | 0,00 |
| 20.855.189 € | 22.204.670 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 847.354 | 0,05 |
| 21.014.712 € | 22.397.886 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | 830.465 | 0,05 |
| 715.941 € | 768.184 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 35 | 23.176 | 0,00 |
| 192.159 US\$ | 173.431 € | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | 460 | 0,00 |
| 230.279 US\$ | 207.209 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | 1.243 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 5.749.654 £ | 7.062.530 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 267.772 | 0,02 |
| 11.499.983 £ | 14.137.567 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 523.896 | 0,03 |
| 1.307.569.327 £ | 1.604.918.204 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 5 | 62.117.329 | 3,82 |
| 66.582.105 £ | 83.043.310 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 42 | 1.843.004 | 0,12 |
| 7.871.393 US\$ | 6.153.780 £ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 25.866 | 0,00 |
| 4.420.721 US\$ | 3.460.814 £ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | 8.488 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen JPY</i> | | | | | | |
| 38.060.740 ¥ | 255.747 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 14.877 | 0,00 |
| 76.467.122 ¥ | 514.202 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 2 | 29.504 | 0,00 |
| 24.070.054 ¥ | 168.765 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | 2.381 | 0,00 |
| 3.989.328.650 ¥ | 27.231.711 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 4 | 1.133.658 | 0,07 |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i> | | | | | | |
| 44.215 SGD | 32.541 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | 1.003 | 0,00 |
| 3.996 SGD | 2.945 US\$ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | 86 | 0,00 |
| 46.465 SGD | 34.118 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 14 | 1.133 | 0,00 |
| 46 US\$ | 60 SGD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 0 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten [~] | | | | | 91.871.867 | 5,65 |

Futures-Kontrakte 1,13 % (31. Dezember 2022: 1,30 %)

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|------------------|---|--------------------------------|----------------------|
| 872 | 1 Month SOFR Future February 2024 | 90.233 | 0,01 |
| 11 | 10-Year Mini Japanese Government Bond Future March 2024 | 1.456 | 0,00 |
| (11) | 3 Month SOFR Future December 2024 | 102.551 | 0,01 |
| 50 | 3 Month SOFR Future December 2025 | 28.900 | 0,00 |
| 1.711 | 3 Month SOFR Future June 2024 | 720.809 | 0,05 |
| 104 | 3 Month SOFR Future June 2025 | 122.535 | 0,01 |
| 75 | 3 Month SOFR Future June 2026 | 37.662 | 0,00 |
| 100 | 3 Month SOFR Future March 2024 | 4.375 | 0,00 |
| 103 | 3 Month SOFR Future March 2025 | 113.765 | 0,01 |
| 51 | 3 Month SOFR Future March 2026 | 32.475 | 0,00 |
| 476 | 3 Month SOFR Future September 2024 | 183.040 | 0,01 |
| 35 | 3 Month SOFR Future September 2025 | 16.450 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Futures-Kontrakte 1,13 % (31. Dezember 2022: 1,30 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|------------------|--|--------------------------------|----------------------|
| 77 | 3 Month SOFR Future September 2026 | 22.012 | 0,00 |
| 87 | 3 Month SOFR Future September 2027 | 15.525 | 0,00 |
| 327 | 3 Month SONIA Future December 2024 | 160.101 | 0,01 |
| 26 | 3 Month SONIA Future December 2025 | 41.192 | 0,00 |
| 341 | 3 Month SONIA Future June 2024 | 69.848 | 0,01 |
| 28 | 3 Month SONIA Future June 2025 | 21.751 | 0,00 |
| 28 | 3 Month SONIA Future June 2026 | 38.818 | 0,00 |
| 405 | 3 Month SONIA Future March 2025 | 340.440 | 0,02 |
| 28 | 3 Month SONIA Future March 2026 | 39.822 | 0,00 |
| 970 | 3 Month SONIA Future September 2024 | 1.388.920 | 0,09 |
| 26 | 3 Month SONIA Future September 2025 | 23.456 | 0,00 |
| 29 | 3 Month SONIA Future September 2026 | 22.580 | 0,00 |
| 1.199 | 30 Day Federal Funds Future January 2024 | 18.929 | 0,00 |
| 89 | 3-Month Euro EURIBOR Future December 2024 | 44.628 | 0,00 |
| 39 | 3-Month Euro EURIBOR Future December 2025 | 10.011 | 0,00 |
| 624 | 3-Month Euro EURIBOR Future December 2026 | 1.191.341 | 0,07 |
| 300 | 3-Month Euro EURIBOR Call Option on Future February 2024, Strike Price EUR 97.50 | 1.762 | 0,00 |
| 349 | 3-Month Euro EURIBOR Future June 2024 | 419.675 | 0,03 |
| 45 | 3-Month Euro EURIBOR Future June 2025 | 21.389 | 0,00 |
| 61 | 3-Month Euro EURIBOR Future June 2026 | 16.625 | 0,00 |
| 415 | 3-Month Euro EURIBOR Future March 2024 | 127.876 | 0,01 |
| (4.500) | 3-Month Euro EURIBOR Put Option on Future March 2024, Strike Price EUR 96.13 | 305.903 | 0,02 |
| 31 | 3-Month Euro EURIBOR Future March 2025 | 24.123 | 0,00 |
| 46 | 3-Month Euro EURIBOR Future March 2026 | 9.624 | 0,00 |
| 91 | 3-Month Euro EURIBOR Future September 2024 | 6.639 | 0,00 |
| 34 | 3-Month Euro EURIBOR Future September 2025 | 11.599 | 0,00 |
| 90 | 90-Day Bank Bill Future December 2024 | 88.712 | 0,01 |
| 335 | 90-Day Bank Bill Future June 2024 | 204.148 | 0,01 |
| 1.469 | 90-Day Bank Bill Future March 2024 | 491.202 | 0,03 |
| 32 | 90-Day Bank Bill Future March 2025 | 35.419 | 0,00 |
| 2 | 90-Day Bank Bill Future September 2024 | 924 | 0,00 |
| 2.008 | Australian Dollar Currency Future March 2024 | 755.052 | 0,05 |
| 206 | Australian Government Bond 10-Year Future March 2024 | 383.246 | 0,02 |
| 42 | Bankers Acceptance Future December 2024 | 11.755 | 0,00 |
| 438 | Bankers Acceptance Future June 2024 | 180 | 0,00 |
| 16 | Bankers Acceptance Future March 2025 | 4.664 | 0,00 |
| 672 | Bankers Acceptance Future September 2024 | 174.882 | 0,01 |
| 51 | Canadian 10-Year Bond Future March 2024 | 27.628 | 0,00 |
| (23) | CBOE VIX Index Future February 2024 | 18.516 | 0,00 |
| (95) | CBOE VIX Index Future January 2024 | 103.636 | 0,01 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Futures-Kontrakte 1,13 % (31. Dezember 2022: 1,30 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|------------------|---|--------------------------------|----------------------|
| 2 | Chinese Yuan Renminbi Currecny Future March 2024 | 289 | 0,00 |
| (9) | DAX Index Future March 2024 | 6.609 | 0,00 |
| 8 | DJIA Micro E-mini Future March 2024 | 5.444 | 0,00 |
| 61 | DJIA Mini E-CBOT Future March 2024 | 392.266 | 0,02 |
| (2) | Dollar Index Future March 2024 | 2.022 | 0,00 |
| 1 | E-mini Consumer Discretionary Future March 2024 | 5.570 | 0,00 |
| 5 | E-mini Industrial Future March 2024 | 15.500 | 0,00 |
| 1 | E-mini Materials Future March 2024 | 700 | 0,00 |
| 60 | E-mini Russell 2000 Index Future March 2024 | 50.983 | 0,00 |
| 2 | E-mini Technology Future March 2024 | 7.970 | 0,00 |
| (225) | Euro Bund Call Option on Future February 2024, Strike Price EUR 140.00 | 35.593 | 0,00 |
| (225) | Euro Bund Put Option on Future February 2024, Strike Price EUR 134.00 | 26.706 | 0,00 |
| 3 | Euro Currency Future March 2024 | 209 | 0,00 |
| 15 | Euro FX Currency Future March 2024 | 9.850 | 0,00 |
| 555 | Euro Stoxx 50 Dividend Index Call Option on Future December 2024, Strike Price EUR 160.00 | 15.479 | 0,00 |
| (339) | Euro Stoxx 50 Future March 2024 | 44.827 | 0,00 |
| 5 | Euro Stoxx 50 Index Dividend Future December 2024 | 2.077 | 0,00 |
| (49) | Euro STOXX Bank Index Future March 2024 | 3.518 | 0,00 |
| 55 | Euro STOXX Bank Index Future March 2024 | 17.366 | 0,00 |
| 2 | Euro/Japanese Yen Currency Future March 2024 | 1.312 | 0,00 |
| 1.575 | Euro-BOBL Future March 2024 | 996.339 | 0,06 |
| 467 | Euro-BTP Future March 2024 | 101.639 | 0,01 |
| (635) | Euro-Bund Future March 2024 | 110.540 | 0,01 |
| 75 | Euro-Buxl 30-Year Bond Put Option on Future February 2024, Strike Price EUR 140.00 | 73.753 | 0,01 |
| 79 | Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2024 | 205.023 | 0,01 |
| 196 | Euro-OAT Future March 2024 | 9.831 | 0,00 |
| 928 | Euro-Schatz Future March 2024 | 284.862 | 0,02 |
| 857 | FTSE 100 Index Future March 2024 | 652.719 | 0,04 |
| 5 | FTSE/JSE Top 40 Index Future March 2024 | 154 | 0,00 |
| 766 | Hang Seng China Enterprises Index Future January 2024 | 1.260.567 | 0,08 |
| (9) | Indian Rupee Currency Future January 2024 | 0 | 0,00 |
| 180 | Japan Government 10-Year Bond (OSE) Future March 2024 | 567.563 | 0,04 |
| 446 | Japanese Yen Currency Future March 2024 | 75.234 | 0,01 |
| 30 | KOSPI 200 Index Future March 2024 | 44.355 | 0,00 |
| 22 | Mexican Peso Currency Future March 2024 | 13.540 | 0,00 |
| 19 | Mini- TOPIX Index Future March 2024 | 1.376 | 0,00 |
| 49 | MSCI EAFE Index Future March 2024 | 165.180 | 0,01 |
| 13 | MSCI Emerging Markets Index Future March 2024 | 7.345 | 0,00 |
| 6 | NASD 100 Micro E-mini Future March 2024 | 6.006 | 0,00 |
| 111 | Nasdaq 100 E-mini Future March 2024 | 403.897 | 0,02 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Futures-Kontrakte 1,13 % (31. Dezember 2022: 1,30 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---|--------------------------------|----------------------|
| 6 | New Zealand Dollar Currency Future March 2024 | 2.610 | 0,00 |
| 9 | Nikkei 225 (CME) Future March 2024 | 11.600 | 0,00 |
| 13 | Nikkei 225 (SGX) Future March 2024 | 19.908 | 0,00 |
| 337 | Nikkei 225 Mini Future March 2024 | 80.841 | 0,01 |
| 2 | NYSE FANG+ Index Future March 2024 | 1.512 | 0,00 |
| 192 | OMXS30 Index Future January 2024 | 86.840 | 0,01 |
| 748 | POSCO Holidings Inc Future January 2024 | 364.523 | 0,02 |
| 538 | S&P 500 E-mini Future March 2024 | 1.657.989 | 0,10 |
| 15 | S&P 500 Micro E-mini Future March 2024 | 246 | 0,00 |
| 12 | S&P E-mini S&P MidCap 400 Future March 2024 | 17.290 | 0,00 |
| 39 | S&P/TSX 60 Index Future March 2024 | 113.152 | 0,01 |
| 81 | SGX FTSE Taiwan Future January 2024 | 50.630 | 0,00 |
| 448 | Short-Term Euro-BTP Future March 2024 | 27.583 | 0,00 |
| 5.546 | SK Hynix Inc Future January 2024 | 577.121 | 0,04 |
| 17 | South African Rand Currency (CME) Future March 2024 | 17.723 | 0,00 |
| 71 | SPI 200 Index Future March 2024 | 123.386 | 0,01 |
| 110 | Swiss Franc Currency Future March 2024 | 87.330 | 0,01 |
| 34 | TOPIX Index Future March 2024 | 51.780 | 0,00 |
| 147 | Turkish Lira Currency Future February 2024 | 639 | 0,00 |
| 4 | United States Dollar/Chinese Yuan Renminbi Currency Future March 2024 | 478 | 0,00 |
| 26 | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2024 | 24.562 | 0,00 |
| 12 | US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2024 | 6.156 | 0,00 |
| 2.862 | US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2024 | 1.140.680 | 0,07 |
| (777) | US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2024 | 144.408 | 0,01 |
| 4 | US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2024 | 5.875 | 0,00 |
| (2) | VSTOXX Future January 2024 | 39 | 0,00 |
| 26 | Yen Denominated Nikkei Future March 2024 | 32.900 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten [±] | | 18.420.818 | 1,13 |

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %)

| Anzahl Kontrakte/ Nominalwert | Fällig- keit | Art | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|----------------------------------|-----------------|--|------------------|------------------------------|
| Kaufoptionen | | | | |
| 35 | 21.06.2024 | AbbVie Inc, Strike Price \$165.00 [±] | 16.363 | 0,00 |
| 24 | 19.01.2024 | AbbVie Inc, Strike Price \$170.00 [±] | 48 | 0,00 |
| 26 | 19.01.2024 | AbbVie Inc, Strike Price \$175.00 [±] | 273 | 0,00 |
| 29 | 21.06.2024 | AbbVie Inc, Strike Price \$180.00 [±] | 3.698 | 0,00 |
| 24 | 19.01.2024 | AbbVie Inc, Strike Price \$190.00 [±] | 24 | 0,00 |
| 2.500.000 USD | 19.01.2024 | Absolute Dispersion Basket, Strike Price 17.00% [∞] | 65 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/ Nominalwert | Fällig- keit | Art | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|------------------------------------|-----------------|---|------------------|------------------------------|
| Kaufsoptionen (Fortsetzung) | | | | |
| 4.000.000 USD | 15.03.2024 | Absolute Dispersion Basket, Strike Price 17.00% [∞] | 532 | 0,00 |
| 5.000.000 USD | 20.12.2024 | Absolute Dispersion Basket, Strike Price 28.00% [∞] | 24.630 | 0,00 |
| 7.500.000 EUR | 28.03.2024 | Absolute Dispersion Basket, Strike Price 20.00% [∞] | 1.682 | 0,00 |
| 1.000.000 EUR | 20.12.2024 | Absolute Dispersion Basket, Strike Price 32.00% [∞] | 8.244 | 0,00 |
| 10 | 19.01.2024 | Adobe Inc, Strike Price \$410.00 [±] | 188.150 | 0,01 |
| 9 | 19.01.2024 | Adobe Inc, Strike Price \$450.00 [±] | 133.560 | 0,01 |
| 20.806 | 09.09.2024 | Advanced Energy Industries Inc, Strike Price \$111.45 [∞] | 262.437 | 0,02 |
| 130.036 | 14.03.2029 | Advanced Energy Industries Inc, Strike Price \$179.76 [∞] | 3.123.000 | 0,19 |
| 29 | 21.06.2024 | Advanced Micro Devices Inc, Strike Price \$115.00 [±] | 114.695 | 0,01 |
| 25 | 21.06.2024 | Advanced Micro Devices Inc, Strike Price \$125.00 [±] | 81.250 | 0,01 |
| 23 | 19.01.2024 | Advanced Micro Devices Inc, Strike Price \$130.00 [±] | 42.377 | 0,00 |
| 40 | 21.06.2024 | Advanced Micro Devices Inc, Strike Price \$135.00 [±] | 103.100 | 0,01 |
| 46 | 19.01.2024 | AeroVironment Inc, Strike Price \$105.00 [±] | 99.820 | 0,01 |
| 38 | 19.01.2024 | AeroVironment Inc, Strike Price \$115.00 [±] | 47.690 | 0,00 |
| 500.000.000 JPY | 22.04.2027 | Aica Kogyo Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 60bps. [∞] | 439.477 | 0,03 |
| 20.000.000 JPY | 26.04.2027 | Aica Kogyo Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 70bps. [∞] | 18.059 | 0,00 |
| 53.892 | 15.08.2025 | Akamai Technologies Inc, Strike Price \$104.07 [∞] | 1.543.899 | 0,10 |
| 33.950 | 21.08.2024 | Akamai Technologies Inc, Strike Price \$109.08 [∞] | 591.491 | 0,04 |
| 125.000 | 15.08.2025 | Akamai Technologies Inc, Strike Price \$150.00 [∞] | 747.732 | 0,05 |
| 121.230 | 21.06.2029 | Akamai Technologies Inc, Strike Price \$180.44 [∞] | 2.084.053 | 0,13 |
| 11 | 19.01.2024 | Align Technology Inc, Strike Price \$310.00 [±] | 1.402 | 0,00 |
| 10 | 19.01.2024 | Align Technology Inc, Strike Price \$340.00 [±] | 2.350 | 0,00 |
| 16 | 21.06.2024 | Ameriprise Financial Inc, Strike Price \$360.00 [±] | 62.480 | 0,01 |
| 19 | 21.06.2024 | Ameriprise Financial Inc, Strike Price \$380.00 [±] | 51.585 | 0,00 |
| 13 | 21.06.2024 | Ameriprise Financial Inc, Strike Price \$390.00 [±] | 28.665 | 0,00 |
| 15 | 21.06.2024 | Ameriprise Financial Inc, Strike Price \$420.00 [±] | 15.675 | 0,00 |
| 900.000.000 JPY | 05.09.2024 | Anair, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 52bps. [∞] | 0 | 0,00 |
| 170.000.000 JPY | 20.08.2024 | Anair, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 55bps. [∞] | 0 | 0,00 |
| 27 | 19.01.2024 | Analog Devices Inc, Strike Price \$210.00 [±] | 1.282 | 0,00 |
| 24 | 19.01.2024 | Analog Devices Inc, Strike Price \$230.00 [±] | 0 | 0,00 |
| 4.000 | 19.01.2024 | Apellis Pharmaceuticals Inc, Strike Price \$40.00 [±] | 8.280.000 | 0,51 |
| 46.946 | 19.01.2024 | Apellis Pharmaceuticals Inc, Strike Price \$42.97 [∞] | 844.497 | 0,05 |
| 400.000 | 19.01.2024 | Apellis Pharmaceuticals Inc, Strike Price \$50.50 [∞] | 4.900.039 | 0,31 |
| 32 | 19.01.2024 | Apple Inc, Strike Price \$175.00 [±] | 58.880 | 0,01 |
| 94 | 19.01.2024 | Apple Inc, Strike Price \$195.00 [±] | 19.834 | 0,00 |
| 56 | 19.01.2024 | Apple Inc, Strike Price \$205.00 [±] | 1.064 | 0,00 |
| 51 | 19.01.2024 | Applied Materials Inc, Strike Price \$130.00 [±] | 165.622 | 0,01 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/ Nominalwert | Fällig- keit | Art | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|------------------------------------|-----------------|---|------------------|------------------------------|
| Kaufsoptionen (Fortsetzung) | | | | |
| 45 | 19.01.2024 | Applied Materials Inc, Strike Price \$145.00 ± | 82.012 | 0,01 |
| 23 | 19.01.2024 | Autodesk Inc, Strike Price \$230.00 ± | 35.190 | 0,00 |
| 21 | 21.06.2024 | Autodesk Inc, Strike Price \$230.00 ± | 65.205 | 0,01 |
| 25 | 21.06.2024 | Autodesk Inc, Strike Price \$240.00 ± | 62.500 | 0,01 |
| 11 | 19.01.2024 | Autodesk Inc, Strike Price \$250.00 ± | 3.080 | 0,00 |
| 18 | 21.06.2024 | Autodesk Inc, Strike Price \$250.00 ± | 35.280 | 0,00 |
| 18 | 19.01.2024 | Autodesk Inc, Strike Price \$260.00 ± | 1.530 | 0,00 |
| 10 | 19.01.2024 | Autodesk Inc, Strike Price \$270.00 ± | 325 | 0,00 |
| 23 | 19.01.2024 | Axon Enterprise Inc, Strike Price \$220.00 ± | 90.275 | 0,01 |
| 19 | 19.01.2024 | Axon Enterprise Inc, Strike Price \$240.00 ± | 38.475 | 0,00 |
| 110 | 19.01.2024 | Bath & Body Works Inc, Strike Price \$42.50 ± | 21.175 | 0,00 |
| 89 | 19.01.2024 | Bath & Body Works Inc, Strike Price \$47.50 ± | 2.670 | 0,00 |
| 12 | 21.06.2024 | Berkshire Hathaway Inc, Strike Price \$380.00 ± | 9.300 | 0,00 |
| 12 | 21.06.2024 | Berkshire Hathaway Inc, Strike Price \$410.00 ± | 2.502 | 0,00 |
| 26 | 19.01.2024 | Best Buy Co Inc, Strike Price \$105.00 ± | 78 | 0,00 |
| 48 | 19.01.2024 | Best Buy Co Inc, Strike Price \$80.00 ± | 5.376 | 0,00 |
| 58 | 19.01.2024 | Best Buy Co Inc, Strike Price \$85.00 ± | 928 | 0,00 |
| 44 | 19.01.2024 | Best Buy Co Inc, Strike Price \$87.50 ± | 264 | 0,00 |
| 87 | 19.01.2024 | Best Buy Co Inc, Strike Price \$90.00 ± | 435 | 0,00 |
| 50 | 19.01.2024 | Best Buy Co Inc, Strike Price \$92.50 ± | 0 | 0,00 |
| 77 | 19.01.2024 | Best Buy Co Inc, Strike Price \$95.00 ± | 154 | 0,00 |
| 75 | 19.01.2024 | Best Buy Co Inc, Strike Price \$97.50 ± | 2.625 | 0,00 |
| 9 | 26.01.2024 | Bill Holdings Inc, Strike Price \$71.00 ± | 10.620 | 0,00 |
| 9 | 21.06.2024 | BlackRock Inc, Strike Price \$820.00 ± | 46.530 | 0,00 |
| 61 | 17.01.2025 | Boyd Gaming Corp, Strike Price \$70.00 ± | 27.755 | 0,00 |
| 67 | 19.01.2024 | Boyd Gaming Corp, Strike Price \$75.00 ± | 0 | 0,00 |
| 59 | 19.01.2024 | Boyd Gaming Corp, Strike Price \$80.00 ± | 0 | 0,00 |
| 47 | 17.01.2025 | Boyd Gaming Corp, Strike Price \$80.00 ± | 8.460 | 0,00 |
| 474.110 | 19.02.2027 | BridgeBio Pharma Inc, Strike Price \$38.73 ∞ | 8.266.044 | 0,51 |
| 1.575.000 | 15.01.2027 | BridgeBio Pharma Inc, Strike Price \$62.12 ∞ | 15.327.157 | 0,94 |
| 1.575.000 | 19.02.2027 | BridgeBio Pharma Inc, Strike Price \$62.12 ∞ | 15.768.873 | 0,97 |
| 5 | 19.01.2024 | Broadcom Inc, Strike Price \$760.00 ± | 179.525 | 0,01 |
| 77 | 19.01.2024 | Cardinal Health Inc, Strike Price \$115.00 ± | 0 | 0,00 |
| 63 | 19.01.2024 | Cardinal Health Inc, Strike Price \$95.00 ± | 41.580 | 0,00 |
| 43 | 17.01.2025 | CarMax Inc, Strike Price \$90.00 ± | 38.270 | 0,00 |
| 37 | 17.01.2025 | CarMax Inc, Strike Price \$97.50 ± | 24.235 | 0,00 |
| 28 | 21.06.2024 | CDW Corp, Strike Price \$230.00 ± | 35.280 | 0,00 |
| 29 | 21.06.2024 | CDW Corp, Strike Price \$240.00 ± | 22.910 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/ Nominalwert | Fällig- keit | Art | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|------------------------------------|-----------------|---|------------------|------------------------------|
| Kaufsoptionen (Fortsetzung) | | | | |
| 25 | 21.06.2024 | CDW Corp, Strike Price \$260.00 ± | 6.063 | 0,00 |
| 32 | 19.01.2024 | Cencora Inc, Strike Price \$195.00 ± | 38.720 | 0,00 |
| 27 | 19.01.2024 | Cencora Inc, Strike Price \$210.00 ± | 3.375 | 0,00 |
| 41 | 19.01.2024 | Cencora Inc, Strike Price \$230.00 ± | 0 | 0,00 |
| 126.665 | 19.01.2024 | Ceridian HCM Holding Inc, Strike Price \$105.13 ∞ | 1.415 | 0,00 |
| 450.000 | 19.01.2024 | Ceridian HCM Holding Inc, Strike Price \$133.33 ∞ | 1.144 | 0,00 |
| 1.800 | 19.01.2024 | Ceridian HCM Holding Inc, Strike Price \$85.00 ± | 0 | 0,00 |
| 60 | 17.01.2025 | Charles Schwab Corp, Strike Price \$65.00 ± | 69.000 | 0,01 |
| 52 | 17.01.2025 | Charles Schwab Corp, Strike Price \$70.00 ± | 48.100 | 0,00 |
| 182 | 19.01.2024 | Chemours Co, Strike Price \$31.00 ± | 24.570 | 0,00 |
| 106 | 17.01.2025 | Chemours Co, Strike Price \$35.00 ± | 38.690 | 0,00 |
| 95 | 17.01.2025 | Chemours Co, Strike Price \$37.00 ± | 28.500 | 0,00 |
| 4 | 21.06.2024 | Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price \$2,030.00 ± | 145.540 | 0,01 |
| 3 | 21.06.2024 | Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price \$2,200.00 ± | 73.500 | 0,01 |
| 4 | 19.01.2024 | Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price \$2,250.00 ± | 25.340 | 0,00 |
| 3 | 19.01.2024 | Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price \$2,460.00 ± | 802 | 0,00 |
| 390 | 21.06.2024 | Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price \$17.00 ± | 178.425 | 0,01 |
| 410 | 21.06.2024 | Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price \$20.00 ± | 110.085 | 0,01 |
| 116 | 19.01.2024 | Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price \$22.00 ± | 1.972 | 0,00 |
| 103 | 19.01.2024 | Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price \$25.00 ± | 309 | 0,00 |
| 130 | 19.01.2024 | Commercial Metals Co, Strike Price \$60.00 ± | 1.690 | 0,00 |
| 111 | 19.01.2024 | Commercial Metals Co, Strike Price \$65.00 ± | 0 | 0,00 |
| 117.000 | 20.11.2026 | Confluent Inc, Strike Price \$138.02 ∞ | 42.974 | 0,00 |
| 117.000 | 18.12.2026 | Confluent Inc, Strike Price \$138.02 ∞ | 47.249 | 0,00 |
| 116.000 | 15.01.2027 | Confluent Inc, Strike Price \$138.02 ∞ | 51.949 | 0,00 |
| 1.500 | 19.01.2024 | Confluent Inc, Strike Price \$20.00 ± | 540.000 | 0,03 |
| 1.000 | 19.01.2024 | Confluent Inc, Strike Price \$50.00 ± | 2.000 | 0,00 |
| 11.700 | 20.11.2026 | Confluent Inc, Strike Price \$76.14 ∞ | 23.913 | 0,00 |
| 11.700 | 18.12.2026 | Confluent Inc, Strike Price \$76.28 ∞ | 25.126 | 0,00 |
| 11.600 | 15.01.2027 | Confluent Inc, Strike Price \$76.41 ∞ | 26.133 | 0,00 |
| 60.469 | 15.01.2027 | Conmed Corp, Strike Price \$110.88 ∞ | 1.878.078 | 0,12 |
| 10.078 | 19.01.2027 | Conmed Corp, Strike Price \$110.88 ∞ | 313.667 | 0,02 |
| 210.000 | 15.01.2027 | Conmed Corp, Strike Price \$249.05 ∞ | 999.182 | 0,06 |
| 439 | 19.01.2024 | Coty Inc, Strike Price \$13.00 ± | 5.487 | 0,00 |
| 408 | 19.01.2024 | Coty Inc, Strike Price \$14.00 ± | 1.428 | 0,00 |
| 28 | 19.01.2024 | CVS Caremark Corp, Strike Price \$105.00 ± | 28 | 0,00 |
| 30 | 19.01.2024 | CVS Caremark Corp, Strike Price \$97.50 ± | 45 | 0,00 |
| 1.130.000.000 JPY | 16.11.2029 | Cybag, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 170bps. ∞ | 378.119 | 0,02 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/ Nominalwert | Fällig- keit | Art | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|------------------------------------|-----------------|--|------------------|------------------------------|
| Kaufsoptionen (Fortsetzung) | | | | |
| 800.000.000 JPY | 13.09.2030 | Daifuku Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 103bps. [∞] | 888.767 | 0,06 |
| 40.000.000 JPY | 13.09.2030 | Daifuku Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 75bps. [∞] | 19.003 | 0,00 |
| 120 | 21.06.2024 | Dave & Buster's Entertainment Inc, Strike Price \$40.00 [±] | 191.400 | 0,01 |
| 2.173.493 | 20.12.2024 | Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR21.13 [∞] | 3.688.974 | 0,23 |
| 2.173.493 | 21.03.2025 | Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR21.13 [∞] | 4.121.849 | 0,26 |
| 2.173.493 | 20.12.2024 | Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR21.97 [∞] | 2.643.435 | 0,17 |
| 2.173.493 | 21.03.2025 | Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR21.97 [∞] | 3.070.171 | 0,19 |
| 102 | 21.06.2024 | Devon Energy Corp, Strike Price \$50.00 [±] | 23.715 | 0,00 |
| 59 | 21.06.2024 | Devon Energy Corp, Strike Price \$55.00 [±] | 6.932 | 0,00 |
| 188 | 19.01.2024 | Devon Energy Corp, Strike Price \$60.00 [±] | 658 | 0,00 |
| 48 | 21.06.2024 | Devon Energy Corp, Strike Price \$60.00 [±] | 2.352 | 0,00 |
| 128 | 19.01.2024 | Devon Energy Corp, Strike Price \$65.00 [±] | 192 | 0,00 |
| 35 | 19.01.2024 | Devon Energy Corp, Strike Price \$75.00 [±] | 35 | 0,00 |
| 35 | 19.01.2024 | Dexcom Inc, Strike Price \$140.00 [±] | 2.187 | 0,00 |
| 52 | 19.01.2024 | Dexcom Inc, Strike Price \$145.00 [±] | 1.560 | 0,00 |
| 28 | 19.01.2024 | Dexcom Inc, Strike Price \$152.50 [±] | 350 | 0,00 |
| 44 | 19.01.2024 | Dexcom Inc, Strike Price \$157.50 [±] | 990 | 0,00 |
| 25 | 21.06.2024 | Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price \$125.00 [±] | 72.625 | 0,01 |
| 26 | 19.01.2024 | Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price \$135.00 [±] | 34.190 | 0,00 |
| 21 | 21.06.2024 | Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price \$135.00 [±] | 46.515 | 0,00 |
| 37 | 21.06.2024 | Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price \$140.00 [±] | 70.670 | 0,01 |
| 71 | 19.01.2024 | Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price \$150.00 [±] | 18.637 | 0,00 |
| 70 | 19.01.2024 | Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price \$165.00 [±] | 1.575 | 0,00 |
| 23 | 19.01.2024 | Dollar Tree Inc, Strike Price \$170.00 [±] | 0 | 0,00 |
| 20 | 19.01.2024 | Dollar Tree Inc, Strike Price \$185.00 [±] | 0 | 0,00 |
| 19 | 19.01.2024 | Domino's Pizza Inc, Strike Price \$340.00 [±] | 139.555 | 0,01 |
| 1.000.000 EUR | 15.03.2024 | Dual digital option: Euro Stoxx 50 and EUR/USD spot rate, Down and In Strike Price EUR 4,200.00 and 1.04 [∞] | 7.649 | 0,00 |
| 1.140.000 EUR | 15.03.2024 | Dual digital option: Euro Stoxx 50 and EUR/USD spot rate, Down and In Strike Price EUR 4,346.20 and 1.05 [∞] | 22.287 | 0,00 |
| 1.400.000 USD | 19.12.2025 | Dual digital option: Euro Stoxx 50 and Euro Stoxx 50 Index Dividend, Strike Price EUR155.00 [∞] | 320.022 | 0,02 |
| 1.000.000 USD | 19.01.2024 | Dual digital option: S&P 500 Index and SOFR rate, Down and In Strike Price \$4.40 [∞] | 817 | 0,00 |
| 2.400.000 USD | 19.01.2024 | Dual digital option: S&P 500 Index and SOFR rate, Down and In Strike Price \$4.40 [∞] | 25.663 | 0,00 |
| 1.350.000 USD | 17.05.2024 | Dual digital option: S&P 500 Index and USD 2 Year SOFR ICE swap rate, Down and In Strike Price \$4,100.00 and 3.76% [∞] | 38.615 | 0,00 |
| 5.000 | 15.09.2025 | Energizer Holdings Inc, Strike Price EUR13.22 [∞] | 1.348.132 | 0,08 |
| 103.656 | 30.10.2024 | Enovis Corp, Strike Price \$47.45 [∞] | 1.431.793 | 0,09 |
| 334.375 | 29.08.2028 | Enovis Corp, Strike Price \$89.72 [∞] | 3.617.196 | 0,22 |
| 110.000 | 17.09.2027 | Envestnet Inc, Strike Price \$110.74 [∞] | 659.936 | 0,04 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/ Nominalwert | Fällig- keit | Art | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|------------------------------------|-----------------|--|------------------|------------------------------|
| Kaufsoptionen (Fortsetzung) | | | | |
| 110.000 | 15.10.2027 | Envestnet Inc, Strike Price \$110.74 [∞] | 680.043 | 0,04 |
| 110.000 | 19.11.2027 | Envestnet Inc, Strike Price \$110.74 [∞] | 705.189 | 0,04 |
| 92.400 | 15.10.2027 | Envestnet Inc, Strike Price \$72.69 [∞] | 947.430 | 0,06 |
| 64 | 21.06.2024 | EQT Corp, Strike Price \$50.00 [±] | 5.504 | 0,00 |
| 53 | 21.06.2024 | EQT Corp, Strike Price \$55.00 [±] | 2.650 | 0,00 |
| 58 | 19.01.2024 | Etsy Inc, Strike Price \$100.00 [±] | 812 | 0,00 |
| 60 | 19.01.2024 | Etsy Inc, Strike Price \$95.00 [±] | 2.010 | 0,00 |
| 340 | 19.01.2024 | Euro Stoxx 50 Index, Strike Price EUR4,525.00 [±] | 175.021 | 0,01 |
| 13 | 19.01.2024 | Euro Stoxx 50 Index, Strike Price EUR4,550.00 [±] | 4.968 | 0,00 |
| 18 | 19.01.2024 | Euro Stoxx 50 Index, Strike Price EUR4,575.00 [±] | 4.951 | 0,00 |
| 106.500.000 EUR | 04.01.2024 | Euro/Swiss Franc Currency Option, Strike Price 0.97 [∞] | 25 | 0,00 |
| 4 | 21.06.2024 | Fair Isaac Corp, Strike Price \$1,020.00 [±] | 84.140 | 0,01 |
| 5 | 21.06.2024 | Fair Isaac Corp, Strike Price \$940.00 [±] | 135.425 | 0,01 |
| 200.000.000 JPY | 18.03.2024 | Fancl Corp, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 50bps. [∞] | 0 | 0,00 |
| 16 | 19.01.2024 | FedEx Corp, Strike Price \$240.00 [±] | 23.160 | 0,00 |
| 25 | 19.01.2024 | FedEx Corp, Strike Price \$250.00 [±] | 16.937 | 0,00 |
| 15 | 19.01.2024 | FedEx Corp, Strike Price \$260.00 [±] | 3.270 | 0,00 |
| 19 | 21.06.2024 | FedEx Corp, Strike Price \$280.00 [±] | 14.725 | 0,00 |
| 15 | 17.01.2025 | FedEx Corp, Strike Price \$280.00 [±] | 28.725 | 0,00 |
| 12 | 21.06.2024 | FedEx Corp, Strike Price \$290.00 [±] | 6.330 | 0,00 |
| 15 | 17.01.2025 | FedEx Corp, Strike Price \$300.00 [±] | 19.125 | 0,00 |
| 17 | 21.06.2024 | FedEx Corp, Strike Price \$310.00 [±] | 3.944 | 0,00 |
| 12 | 21.06.2024 | FedEx Corp, Strike Price \$320.00 [±] | 1.740 | 0,00 |
| 173.640 | 09.08.2024 | Fluor Corp, Strike Price \$36.19 [∞] | 1.158.337 | 0,07 |
| 300.000 | 15.06.2029 | Fluor Corp, Strike Price \$68.50 [∞] | 2.571.255 | 0,16 |
| 300.000 | 13.07.2029 | Fluor Corp, Strike Price \$68.50 [∞] | 2.612.845 | 0,16 |
| 300.000 | 13.08.2029 | Fluor Corp, Strike Price \$68.50 [∞] | 2.659.261 | 0,16 |
| 52 | 19.01.2024 | Foot Locker Inc, Strike Price \$50.00 [±] | 52 | 0,00 |
| 47 | 19.01.2024 | Foot Locker Inc, Strike Price \$55.00 [±] | 0 | 0,00 |
| 46 | 19.01.2024 | Fortinet Inc, Strike Price \$75.00 [±] | 368 | 0,00 |
| 39 | 19.01.2024 | Fortinet Inc, Strike Price \$82.00 [±] | 0 | 0,00 |
| 136 | 21.06.2024 | Freeport-McMoRan Inc, Strike Price \$40.00 [±] | 78.540 | 0,01 |
| 800.000.000 JPY | 08.06.2026 | GMO Payment Gateway Inc, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 70bps. [∞] | 24.267 | 0,00 |
| 1.045 | 15.03.2024 | GSK Plc, Strike Price GBP1,520.00 [±] | 392.989 | 0,03 |
| 29.267 | 19.01.2024 | Guardant Health Inc, Strike Price \$107.62 [∞] | 1 | 0,00 |
| 200.000 | 19.01.2024 | Guardant Health Inc, Strike Price \$126.14 [∞] | 7 | 0,00 |
| 68 | 21.06.2024 | Halliburton Co, Strike Price \$47.00 [±] | 3.740 | 0,00 |
| 59 | 21.06.2024 | Halliburton Co, Strike Price \$50.00 [±] | 1.829 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/ Nominalwert | Fällig- keit | Art | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|------------------------------------|-----------------|--|------------------|------------------------------|
| Kaufsoptionen (Fortsetzung) | | | | |
| 3.000 | 15.03.2024 | Hang Seng China Enterprises Index, Strike Price HKD6,200.00 ± | 2.554.892 | 0,16 |
| 1.210 | 19.01.2024 | Hang Seng China Enterprises Index, Strike Price HKD6,300.00 ± | 139.463 | 0,01 |
| 467 | 19.01.2024 | Hang Seng China Enterprises Index, Strike Price HKD6,400.00 ± | 35.884 | 0,00 |
| 260 | 19.01.2024 | Hang Seng China Enterprises Index, Strike Price HKD6,500.00 ± | 13.319 | 0,00 |
| 6 | 19.01.2024 | Hang Seng Index Future, Strike Price HKD17,000.00 ± | 15.944 | 0,00 |
| 835 | 19.01.2024 | Hang Seng Index Future, Strike Price HKD18,400.00 ± | 261.988 | 0,02 |
| 27 | 19.01.2024 | Hess Corp, Strike Price \$140.00 ± | 19.980 | 0,00 |
| 25 | 19.01.2024 | Hess Corp, Strike Price \$150.00 ± | 6.250 | 0,00 |
| 600.000.000 JPY | 05.09.2024 | Hosele Corp, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 75bps. ∞ | 29.019 | 0,00 |
| 105 | 19.01.2024 | HP Inc, Strike Price \$34.00 ± | 105 | 0,00 |
| 88 | 19.01.2024 | HP Inc, Strike Price \$37.00 ± | 88 | 0,00 |
| 148 | 15.03.2024 | Insulet Corp, Strike Price \$190.00 ± | 534.280 | 0,03 |
| 10.659 | 17.07.2026 | Insulet Corp, Strike Price \$321.48 ∞ | 360.362 | 0,02 |
| 50.000 | 17.07.2026 | Insulet Corp, Strike Price \$335.00 ∞ | 1.529.112 | 0,10 |
| 350.000.000 JPY | 28.09.2028 | JAFCO Group Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 167bps. ∞ | 280.040 | 0,02 |
| 1.150.000.000 JPY | 28.09.2028 | JFE Holdings Inc, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 90bps. ∞ | 727.233 | 0,05 |
| 61 | 19.01.2024 | Kroger Co, Strike Price \$50.00 ± | 244 | 0,00 |
| 260 | 19.01.2024 | Kroger Co, Strike Price \$55.00 ± | 520 | 0,00 |
| 73 | 19.01.2024 | Kroger Co, Strike Price \$60.00 ± | 292 | 0,00 |
| 7 | 19.01.2024 | Lam Research Corp, Strike Price \$550.00 ± | 164.657 | 0,01 |
| 10 | 19.01.2024 | Lam Research Corp, Strike Price \$560.00 ± | 225.525 | 0,02 |
| 6 | 19.01.2024 | Lam Research Corp, Strike Price \$590.00 ± | 117.390 | 0,01 |
| 9 | 19.01.2024 | Lam Research Corp, Strike Price \$610.00 ± | 158.377 | 0,01 |
| 87 | 19.01.2024 | Las Vegas Sands Corp, Strike Price \$60.00 ± | 174 | 0,00 |
| 74 | 19.01.2024 | Las Vegas Sands Corp, Strike Price \$65.00 ± | 148 | 0,00 |
| 64 | 19.01.2024 | Las Vegas Sands Corp, Strike Price \$70.00 ± | 288 | 0,00 |
| 12.952 | 15.12.2028 | Live Nation Entertainment Inc, Strike Price \$101.56 ∞ | 416.563 | 0,03 |
| 80.000 | 15.12.2028 | Live Nation Entertainment Inc, Strike Price \$145.00 ∞ | 1.552.651 | 0,10 |
| 52 | 19.01.2024 | Louisiana-Pacific Corp, Strike Price \$65.00 ± | 32.760 | 0,00 |
| 45 | 19.01.2024 | Louisiana-Pacific Corp, Strike Price \$70.00 ± | 11.250 | 0,00 |
| 52 | 19.01.2024 | Louisiana-Pacific Corp, Strike Price \$82.50 ± | 520 | 0,00 |
| 24 | 21.06.2024 | Lowe's Companies Inc, Strike Price \$220.00 ± | 41.520 | 0,00 |
| 21 | 21.06.2024 | Lowe's Companies Inc, Strike Price \$240.00 ± | 16.643 | 0,00 |
| 14 | 19.01.2024 | Lululemon Athletica Inc, Strike Price \$410.00 ± | 144.445 | 0,01 |
| 12 | 19.01.2024 | Lululemon Athletica Inc, Strike Price \$450.00 ± | 75.900 | 0,01 |
| 1.768 | 19.01.2024 | Lyft Inc, Strike Price \$16.00 ± | 76.024 | 0,01 |
| 5.652 | 19.01.2024 | Lyft Inc, Strike Price \$32.50 ± | 5.652 | 0,00 |
| 601 | 19.01.2024 | Lyft Inc, Strike Price \$40.00 ± | 0 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/ Nominalwert | Fällig- keit | Art | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|------------------------------------|-----------------|--|------------------|------------------------------|
| Kaufsoptionen (Fortsetzung) | | | | |
| 168.821 | 19.01.2024 | Lyft Inc, Strike Price \$41.56 [∞] | 60 | 0,00 |
| 800.000 | 19.01.2024 | Lyft Inc, Strike Price \$48.73 [∞] | 133 | 0,00 |
| 214.527 | 19.01.2024 | Lyft Inc, Strike Price \$56.35 [∞] | 19 | 0,00 |
| 1.000.000 | 19.01.2024 | Lyft Inc, Strike Price \$60.00 [∞] | 68 | 0,00 |
| 49 | 21.06.2024 | LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$100.00 [±] | 18.620 | 0,00 |
| 49 | 19.01.2024 | LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$109.80 [±] | 1.470 | 0,00 |
| 41 | 21.06.2024 | LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$110.00 [±] | 5.330 | 0,00 |
| 54 | 19.01.2024 | LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$99.80 [±] | 1.890 | 0,00 |
| 183 | 21.06.2024 | Marathon Oil Corp, Strike Price \$28.00 [±] | 19.032 | 0,00 |
| 1.111 | 19.01.2024 | Marriott Vacations Worldwide Corp, Strike Price \$135.00 [±] | 0 | 0,00 |
| 78.605 | 19.01.2024 | Marriott Vacations Worldwide Corp, Strike Price \$148.83 [∞] | 73 | 0,00 |
| 283.302 | 19.01.2024 | Marriott Vacations Worldwide Corp, Strike Price \$192.36 [∞] | 14 | 0,00 |
| 2.114 | 19.01.2024 | Match Group Inc, Strike Price \$110.00 [±] | 0 | 0,00 |
| 76.632 | 19.01.2024 | Match Group Inc, Strike Price \$125.67 [∞] | 1 | 0,00 |
| 124.502 | 19.01.2024 | Match Group Inc, Strike Price \$132.97 [∞] | 1 | 0,00 |
| 200 | 19.01.2024 | Match Group Inc, Strike Price \$140.00 [±] | 0 | 0,00 |
| 1.157 | 19.01.2024 | Match Group Inc, Strike Price \$145.00 [±] | 0 | 0,00 |
| 103.560 | 19.01.2024 | Match Group Inc, Strike Price \$163.96 [∞] | 1 | 0,00 |
| 240.000 | 19.01.2024 | Match Group Inc, Strike Price \$171.93 [∞] | 1 | 0,00 |
| 400.000 | 19.01.2024 | Match Group Inc, Strike Price \$181.99 [∞] | 1 | 0,00 |
| 350.000 | 19.01.2024 | Match Group Inc, Strike Price \$224.97 [∞] | 0 | 0,00 |
| 2.550 | 19.01.2024 | Match Group Inc, Strike Price \$40.00 [±] | 81.600 | 0,01 |
| 530.000.000 JPY | 29.01.2025 | Menicon Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 50bps. [∞] | 23.210 | 0,00 |
| 13 | 21.06.2024 | Meta Platforms Inc, Strike Price \$310.00 [±] | 85.540 | 0,01 |
| 11 | 21.06.2024 | Meta Platforms Inc, Strike Price \$340.00 [±] | 50.792 | 0,00 |
| 14 | 21.06.2024 | Meta Platforms Inc, Strike Price \$350.00 [±] | 56.700 | 0,00 |
| 15 | 21.06.2024 | Meta Platforms Inc, Strike Price \$365.00 [±] | 49.425 | 0,00 |
| 13 | 21.06.2024 | Meta Platforms Inc, Strike Price \$380.00 [±] | 34.418 | 0,00 |
| 106 | 16.10.2024 | Metlife Inc, Strike Price \$71.00 [±] | 40.716 | 0,00 |
| 106 | 17.10.2024 | Metlife Inc, Strike Price \$71.00 [±] | 40.851 | 0,00 |
| 106 | 18.10.2024 | Metlife Inc, Strike Price \$71.00 [±] | 40.996 | 0,00 |
| 52 | 21.06.2024 | Microchip Technology Inc, Strike Price \$87.50 [±] | 51.480 | 0,00 |
| 47 | 21.06.2024 | Microchip Technology Inc, Strike Price \$95.00 [±] | 28.905 | 0,00 |
| 58 | 19.01.2024 | Micron Technology Inc, Strike Price \$67.50 [±] | 104.835 | 0,01 |
| 52 | 19.01.2024 | Micron Technology Inc, Strike Price \$75.00 [±] | 57.850 | 0,01 |
| 59 | 21.06.2024 | Micron Technology Inc, Strike Price \$77.50 [±] | 79.798 | 0,01 |
| 177 | 21.06.2024 | Micron Technology Inc, Strike Price \$85.00 [±] | 159.300 | 0,01 |
| 50 | 21.06.2024 | Micron Technology Inc, Strike Price \$95.00 [±] | 24.000 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/ Nominalwert | Fällig- keit | Art | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|------------------------------------|-----------------|--|------------------|------------------------------|
| Kaufsoptionen (Fortsetzung) | | | | |
| 45.713 | 18.07.2025 | Middleby Corp, Strike Price \$150.83 [∞] | 1.096.375 | 0,07 |
| 112.500 | 18.07.2025 | Middleby Corp, Strike Price \$210.00 [∞] | 659.978 | 0,04 |
| 1.020.000.000 JPY | 12.11.2024 | Nagoya, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 38bps. [∞] | 15.922 | 0,00 |
| 1.000.000.000 JPY | 11.12.2024 | Nagoya, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 50bps. [∞] | 20.124 | 0,00 |
| 370.000.000 JPY | 27.11.2024 | Nagoya, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 60bps. [∞] | 9.268 | 0,00 |
| 81 | 19.01.2024 | NetApp Inc, Strike Price \$95.00 [±] | 810 | 0,00 |
| 9 | 21.06.2024 | Netflix Inc, Strike Price \$440.00 [±] | 72.540 | 0,01 |
| 6 | 21.06.2024 | Netflix Inc, Strike Price \$490.00 [±] | 31.035 | 0,00 |
| 10 | 17.01.2025 | Netflix Inc, Strike Price \$490.00 [±] | 82.725 | 0,01 |
| 11 | 21.06.2024 | Netflix Inc, Strike Price \$520.00 [±] | 41.690 | 0,00 |
| 7 | 17.01.2025 | Netflix Inc, Strike Price \$530.00 [±] | 45.133 | 0,00 |
| 10 | 21.06.2024 | Netflix Inc, Strike Price \$570.00 [±] | 21.550 | 0,00 |
| 48 | 21.06.2024 | Neurocrine Biosciences Inc, Strike Price \$120.00 [±] | 89.760 | 0,01 |
| 40 | 21.06.2024 | Neurocrine Biosciences Inc, Strike Price \$130.00 [±] | 50.400 | 0,00 |
| 11 | 12.01.2024 | Nikkei 225 Index, Strike Price JPY34,000.00 [±] | 11.704 | 0,00 |
| 23 | 12.01.2024 | Nikkei 225 Index, Strike Price JPY34,500.00 [±] | 9.136 | 0,00 |
| 91 | 12.01.2024 | Nikkei 225 Index, Strike Price JPY34,750.00 [±] | 21.946 | 0,00 |
| 191 | 12.01.2024 | Nikkei 225 Index, Strike Price JPY35,000.00 [±] | 28.451 | 0,00 |
| 11 | 09.02.2024 | Nikkei 225 Index, Strike Price JPY35,000.00 [±] | 15.605 | 0,00 |
| 146 | 12.01.2024 | Nikkei 225 Index, Strike Price JPY35,250.00 [±] | 13.463 | 0,00 |
| 67 | 12.01.2024 | Nikkei 225 Index, Strike Price JPY35,500.00 [±] | 4.277 | 0,00 |
| 1.200.000.000 JPY | 04.10.2024 | Nippon 24, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 55bps. [∞] | 2.993.420 | 0,19 |
| 1.200.000.000 JPY | 05.10.2026 | Nippon 26, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 65bps. [∞] | 3.070.843 | 0,19 |
| 10.000.000 JPY | 04.09.2026 | Nippon Steel Corp, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 49bps. [∞] | 24.656 | 0,00 |
| 33 | 21.06.2024 | Nucor Corp, Strike Price \$175.00 [±] | 47.768 | 0,00 |
| 28 | 21.06.2024 | Nucor Corp, Strike Price \$190.00 [±] | 24.850 | 0,00 |
| 2.986 | 19.01.2024 | Okta Inc, Strike Price \$170.00 [±] | 31.353 | 0,00 |
| 49.339 | 19.01.2024 | Okta Inc, Strike Price \$220.35 [∞] | 35 | 0,00 |
| 64.205 | 19.01.2024 | Okta Inc, Strike Price \$222.80 [∞] | 43 | 0,00 |
| 200.000 | 19.01.2024 | Okta Inc, Strike Price \$258.28 [∞] | 61 | 0,00 |
| 250.000 | 19.01.2024 | Okta Inc, Strike Price \$260.83 [∞] | 73 | 0,00 |
| 30 | 19.01.2024 | ON Semiconductor Corp, Strike Price \$100.00 [±] | 360 | 0,00 |
| 446.500 | 29.06.2029 | ON Semiconductor Corp, Strike Price \$156.78 [∞] | 9.231.876 | 0,57 |
| 446.500 | 06.07.2029 | ON Semiconductor Corp, Strike Price \$156.78 [∞] | 9.267.077 | 0,57 |
| 151.810 | 28.02.2024 | ON Semiconductor Corp, Strike Price \$82.83 [∞] | 1.022.622 | 0,06 |
| 36 | 19.01.2024 | ON Semiconductor Corp, Strike Price \$90.00 [±] | 2.880 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/ Nominalwert | Fällig- keit | Art | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|------------------------------------|-----------------|--|------------------|------------------------------|
| Kaufsoptionen (Fortsetzung) | | | | |
| 77 | 19.01.2024 | ONEOK Inc, Strike Price \$67.50 ± | 27.720 | 0,00 |
| 68 | 19.01.2024 | ONEOK Inc, Strike Price \$72.50 ± | 2.720 | 0,00 |
| 87 | 21.06.2024 | ONEOK Inc, Strike Price \$72.50 ± | 26.970 | 0,00 |
| 71 | 21.06.2024 | ONEOK Inc, Strike Price \$80.00 ± | 7.100 | 0,00 |
| 150.000.000 JPY | 14.12.2028 | OSG Corp, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 60bps. ∞ | 88.842 | 0,01 |
| 75.000 | 21.11.2025 | Palo Alto Networks Inc, Strike Price \$193.96 ∞ | 9.711.184 | 0,60 |
| 662 | 19.01.2024 | PG&E Corp, Strike Price \$19.00 ± | 5.296 | 0,00 |
| 167 | 19.01.2024 | PG&E Corp, Strike Price \$20.00 ± | 501 | 0,00 |
| 219 | 17.01.2025 | PG&E Corp, Strike Price \$20.00 ± | 30.441 | 0,00 |
| 508 | 19.01.2024 | PG&E Corp, Strike Price \$21.00 ± | 0 | 0,00 |
| 25 | 19.01.2024 | Pioneer Natural Resources Co, Strike Price \$250.00 ± | 500 | 0,00 |
| 23 | 19.01.2024 | Pioneer Natural Resources Co, Strike Price \$270.00 ± | 230 | 0,00 |
| 122 | 17.07.2024 | POSCO Holdings Inc, Strike Price KRW488,000.00 ∞ | 5.699 | 0,00 |
| 55 | 21.06.2024 | Prudential Financial Inc, Strike Price \$105.00 ± | 30.525 | 0,00 |
| 57 | 19.01.2024 | Qorvo Inc, Strike Price \$125.00 ± | 798 | 0,00 |
| 37 | 21.06.2024 | Ralph Lauren Corp, Strike Price \$125.00 ± | 95.460 | 0,01 |
| 35 | 21.06.2024 | Ralph Lauren Corp, Strike Price \$135.00 ± | 63.875 | 0,01 |
| 54 | 19.01.2024 | Ralph Lauren Corp, Strike Price \$145.00 ± | 15.255 | 0,00 |
| 48 | 19.01.2024 | Ralph Lauren Corp, Strike Price \$155.00 ± | 1.440 | 0,00 |
| 151 | 19.01.2024 | Range Resources Corp, Strike Price \$29.00 ± | 29.445 | 0,00 |
| 132 | 19.01.2024 | Range Resources Corp, Strike Price \$31.00 ± | 10.230 | 0,00 |
| 142 | 21.06.2024 | Range Resources Corp, Strike Price \$35.00 ± | 24.850 | 0,00 |
| 138 | 21.06.2024 | Range Resources Corp, Strike Price \$37.00 ± | 16.905 | 0,00 |
| 77 | 21.06.2024 | Range Resources Corp, Strike Price \$39.00 ± | 6.545 | 0,00 |
| 116 | 21.06.2024 | Range Resources Corp, Strike Price \$40.00 ± | 8.120 | 0,00 |
| 67 | 21.06.2024 | Range Resources Corp, Strike Price \$42.00 ± | 3.350 | 0,00 |
| 23 | 19.01.2024 | RH, Strike Price \$280.00 ± | 43.240 | 0,00 |
| 17 | 19.01.2024 | RH, Strike Price \$300.00 ± | 14.280 | 0,00 |
| 11 | 19.01.2024 | RH, Strike Price \$310.00 ± | 5.775 | 0,00 |
| 14 | 19.01.2024 | RH, Strike Price \$330.00 ± | 2.765 | 0,00 |
| 10 | 21.06.2024 | RH, Strike Price \$390.00 ± | 11.500 | 0,00 |
| 9 | 21.06.2024 | RH, Strike Price \$420.00 ± | 6.750 | 0,00 |
| 701 | 15.03.2024 | S&P 500 E-mini Call Option on Future, Strike Price \$4,350.00 ± | 17.016.775 | 1,05 |
| 1 | 19.01.2024 | S&P 500 E-mini Call Option on Future, Strike Price \$4,650.00 ± | 8.888 | 0,00 |
| 73 | 19.01.2024 | S&P 500 E-mini Call Option on Future, Strike Price \$4,670.00 ± | 582.175 | 0,04 |
| 106 | 19.01.2024 | S&P 500 E-mini Call Option on Future, Strike Price \$4,780.00 ± | 373.650 | 0,02 |
| 2 | 19.01.2024 | S&P 500 E-mini Call Option on Future, Strike Price \$4,830.00 ± | 4.100 | 0,00 |
| 360 | 31.01.2024 | S&P 500 E-mini Call Option on Future, Strike Price \$4,950.00 ± | 252.000 | 0,02 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/ Nominalwert | Fällig- keit | Art | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|------------------------------------|-----------------|--|------------------|------------------------------|
| Kaufsoptionen (Fortsetzung) | | | | |
| 23 | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,425.00 ± | 833.865 | 0,06 |
| 1 | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,740.00 ± | 7.310 | 0,00 |
| 1 | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,770.00 ± | 5.360 | 0,00 |
| 64 | 16.02.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$5,150.00 ± | 11.680 | 0,00 |
| 64 | 16.02.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$5,500.00 ± | 1.120 | 0,00 |
| 202 | 19.01.2024 | Sarepta Therapeutics Inc, Strike Price \$70.00 ± | 543.380 | 0,03 |
| 4.000 | 19.01.2024 | Sarepta Therapeutics Inc, Strike Price \$75.00 ± | 8.780.000 | 0,54 |
| 48.561 | 19.01.2024 | Sarepta Therapeutics Inc, Strike Price \$82.73 ∞ | 723.522 | 0,04 |
| 400.000 | 19.01.2024 | Sarepta Therapeutics Inc, Strike Price \$96.97 ∞ | 2.092.308 | 0,13 |
| 1.150.000.000 JPY | 25.07.2025 | SBI Group, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 110bps. ∞ | 1.525.114 | 0,10 |
| 1.200.000.000 JPY | 11.07.2025 | SBI Group, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 148bps. ∞ | 1.636.795 | 0,10 |
| 1.000.000.000 JPY | 25.07.2025 | SBI Group, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 148bps. ∞ | 1.368.065 | 0,09 |
| 216.740 | 01.05.2028 | Seagate Technology Holdings Plc, Strike Price \$107.85 ∞ | 3.269.921 | 0,20 |
| 36.846 | 09.09.2024 | Seagate Technology Holdings Plc, Strike Price \$64.30 ∞ | 896.473 | 0,06 |
| 58.277 | 21.01.2028 | Semtech Corp, Strike Price \$41.74 ∞ | 368.205 | 0,02 |
| 400.000 | 21.01.2028 | Semtech Corp, Strike Price \$51.00 ∞ | 2.136.019 | 0,13 |
| 11 | 19.01.2024 | ServiceNow Inc, Strike Price \$480.00 ± | 251.625 | 0,02 |
| 10 | 19.01.2024 | ServiceNow Inc, Strike Price \$530.00 ± | 177.850 | 0,01 |
| 11 | 21.06.2024 | ServiceNow Inc, Strike Price \$620.00 ± | 137.390 | 0,01 |
| 9 | 21.06.2024 | ServiceNow Inc, Strike Price \$680.00 ± | 76.995 | 0,01 |
| 18 | 21.06.2024 | ServiceNow Inc, Strike Price \$740.00 ± | 97.830 | 0,01 |
| 9 | 21.06.2024 | ServiceNow Inc, Strike Price \$800.00 ± | 27.900 | 0,00 |
| 24 | 19.01.2024 | Sherwin-Williams Co, Strike Price \$260.00 ± | 126.960 | 0,01 |
| 22 | 19.01.2024 | Sherwin-Williams Co, Strike Price \$280.00 ± | 72.600 | 0,01 |
| 1.050 | 21.06.2024 | Shift4 Payments Inc, Strike Price \$120.40 ∞ | 25.039 | 0,00 |
| 1.050 | 19.07.2024 | Shift4 Payments Inc, Strike Price \$120.40 ∞ | 38.654 | 0,00 |
| 1.050 | 16.08.2024 | Shift4 Payments Inc, Strike Price \$120.40 ∞ | 55.661 | 0,00 |
| 1.465 | 16.02.2024 | Shift4 Payments Inc, Strike Price \$80.00 ± | 476.125 | 0,03 |
| 4.610 | 20.12.2024 | Siemens Energy AG, Strike Price EUR13.00 ± | 903.907 | 0,06 |
| 38 | 21.06.2024 | Signet Jewelers Ltd, Strike Price \$85.00 ± | 106.970 | 0,01 |
| 33 | 21.06.2024 | Signet Jewelers Ltd, Strike Price \$90.00 ± | 81.015 | 0,01 |
| 45 | 21.06.2024 | Simon Property Group Inc, Strike Price \$135.00 ± | 64.575 | 0,01 |
| 40 | 21.06.2024 | Simon Property Group Inc, Strike Price \$145.00 ± | 34.600 | 0,00 |
| 49.453 | 11.01.2024 | SK Hynix Inc, Strike Price KRW88,200.00 ∞ | 2.049.762 | 0,13 |
| 113 | 19.01.2024 | Skechers USA Inc, Strike Price \$60.00 ± | 35.030 | 0,00 |
| 65 | 19.01.2024 | Skyworks Solutions Inc, Strike Price \$120.00 ± | 2.437 | 0,00 |
| 96 | 19.01.2024 | Skyworks Solutions Inc, Strike Price \$130.00 ± | 960 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/ Nominalwert | Fällig- keit | Art | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|------------------------------------|-----------------|---|------------------|------------------------------|
| Kaufsoptionen (Fortsetzung) | | | | |
| 37 | 19.01.2024 | Skyworks Solutions Inc, Strike Price \$140.00 ± | 185 | 0,00 |
| 894.454 | 28.02.2030 | Stem Inc, Strike Price \$11.18 ∞ | 1.740.099 | 0,11 |
| 89.445 | 01.04.2024 | Stem Inc, Strike Price \$5.87 ∞ | 21.669 | 0,00 |
| 734 | 19.01.2024 | Sunnova Energy International Inc, Strike Price \$30.00 ± | 5.505 | 0,00 |
| 67.492 | 19.01.2024 | Sunnova Energy International Inc, Strike Price \$37.85 ∞ | 465 | 0,00 |
| 400.000 | 19.01.2024 | Sunnova Energy International Inc, Strike Price \$48.06 ∞ | 893 | 0,00 |
| 50 | 19.01.2024 | T Rowe Price Group Inc, Strike Price \$120.00 ± | 500 | 0,00 |
| 34 | 17.01.2025 | T Rowe Price Group Inc, Strike Price \$120.00 ± | 23.970 | 0,00 |
| 28 | 17.01.2025 | T Rowe Price Group Inc, Strike Price \$130.00 ± | 11.340 | 0,00 |
| 44 | 19.01.2024 | T Rowe Price Group Inc, Strike Price \$135.00 ± | 0 | 0,00 |
| 34 | 17.01.2024 | Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD18,200.00 ± | 4.598 | 0,00 |
| 1.280.000.000 JPY | 19.09.2030 | Taiyo Yuden Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 70bps. ∞ | 1.423.181 | 0,09 |
| 32 | 21.06.2024 | Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price \$155.00 ± | 57.520 | 0,00 |
| 20 | 19.01.2024 | Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price \$165.00 ± | 3.510 | 0,00 |
| 26 | 21.06.2024 | Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price \$170.00 ± | 27.170 | 0,00 |
| 42 | 19.01.2024 | Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price \$180.00 ± | 504 | 0,00 |
| 217 | 19.01.2024 | Tanger Factory Outlet Centers Inc, Strike Price \$24.00 ± | 82.460 | 0,01 |
| 185 | 19.01.2024 | Tanger Factory Outlet Centers Inc, Strike Price \$26.00 ± | 37.462 | 0,00 |
| 77 | 19.01.2024 | Targa Resources Corp, Strike Price \$77.50 ± | 73.150 | 0,01 |
| 55 | 21.06.2024 | TD SYNEX Corp, Strike Price \$110.00 ± | 39.600 | 0,00 |
| 120 | 19.01.2024 | Tenet Healthcare Corp, Strike Price \$75.00 ± | 34.200 | 0,00 |
| 34 | 19.01.2024 | Tenet Healthcare Corp, Strike Price \$85.00 ± | 850 | 0,00 |
| 14 | 21.06.2024 | Tesla Motors Inc, Strike Price \$240.00 ± | 55.755 | 0,00 |
| 13 | 21.06.2024 | Tesla Motors Inc, Strike Price \$260.00 ± | 39.357 | 0,00 |
| 34.900 | 19.08.2024 | Tetra Tech Inc, Strike Price \$165.63 ∞ | 616.297 | 0,04 |
| 127.138 | 17.07.2028 | Tetra Tech Inc, Strike Price \$259.56 ∞ | 2.379.231 | 0,15 |
| 28 | 19.01.2024 | Texas Instruments Inc, Strike Price \$200.00 ± | 112 | 0,00 |
| 26 | 19.01.2024 | Texas Instruments Inc, Strike Price \$220.00 ± | 130 | 0,00 |
| 49 | 21.06.2024 | Thor Industries Inc, Strike Price \$115.00 ± | 68.600 | 0,01 |
| 42 | 21.06.2024 | Thor Industries Inc, Strike Price \$125.00 ± | 38.430 | 0,00 |
| 480.000 | 21.06.2024 | T-Mobile US Inc, Strike Price \$160.95 ∞ | 4.465.873 | 0,28 |
| 540.000.000 JPY | 13.09.2030 | Tokyu Corp, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 100bps. ∞ | 224.826 | 0,02 |
| 230.000.000 JPY | 29.09.2028 | Tokyu Corp, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 85bps. ∞ | 101.077 | 0,01 |
| 23 | 19.01.2024 | Tractor Supply Co, Strike Price \$250.00 ± | 460 | 0,00 |
| 20 | 19.01.2024 | Tractor Supply Co, Strike Price \$280.00 ± | 0 | 0,00 |
| 1.000.000.000 JPY | 13.11.2026 | Transcosmos Inc, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 45bps. ∞ | 149.476 | 0,01 |
| 7 | 19.01.2024 | Ulta Beauty Inc, Strike Price \$580.00 ± | 119 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/ Nominalwert | Fällig- keit | Art | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|------------------------------------|-----------------|--|------------------|------------------------------|
| Kaufsoptionen (Fortsetzung) | | | | |
| 11 | 19.01.2024 | Ulta Beauty Inc, Strike Price \$600.00 ± | 110 | 0,00 |
| 7 | 19.01.2024 | Ulta Beauty Inc, Strike Price \$620.00 ± | 0 | 0,00 |
| 9 | 19.01.2024 | Ulta Beauty Inc, Strike Price \$660.00 ± | 90 | 0,00 |
| 150.000.000 USD | 18.04.2024 | United States Dollar/Hong Kong Dollar Currency Option, Strike Price 7.85 ∞ | 45.900 | 0,00 |
| 120 | 19.01.2024 | United States Steel Corp, Strike Price \$24.00 ± | 298.800 | 0,02 |
| 104 | 19.01.2024 | United States Steel Corp, Strike Price \$26.00 ± | 238.160 | 0,02 |
| 29 | 21.06.2024 | Universal Display Corp, Strike Price \$185.00 ± | 72.355 | 0,01 |
| 1.035 | 26.01.2024 | US Treasury 10-Year Note Call Option on Futures, Strike Price \$114.00 ± | 501.328 | 0,03 |
| 1.803 | 21.06.2024 | Variance on the S&P 500 Index, Strike Price 30% ∞ | 23.501 | 0,00 |
| 78 | 21.06.2024 | Voya Financial Inc, Strike Price \$77.50 ± | 20.670 | 0,00 |
| 29 | 19.01.2024 | Walmart Inc, Strike Price \$160.00 ± | 3.857 | 0,00 |
| 27 | 19.01.2024 | Walmart Inc, Strike Price \$175.00 ± | 121 | 0,00 |
| 513 | 19.01.2024 | Wayfair Inc, Strike Price \$195.00 ± | 19.237 | 0,00 |
| 41.564 | 19.01.2024 | Wayfair Inc, Strike Price \$210.42 ∞ | 5 | 0,00 |
| 37.717 | 19.01.2024 | Wayfair Inc, Strike Price \$252.89 ∞ | 1 | 0,00 |
| 49.550 | 19.01.2024 | Wayfair Inc, Strike Price \$253.24 ∞ | 0 | 0,00 |
| 20.000 | 09.01.2024 | Wayfair Inc, Strike Price \$267.94 ∞ | 0 | 0,00 |
| 160.000 | 19.01.2024 | Wayfair Inc, Strike Price \$267.94 ∞ | 4 | 0,00 |
| 160.000 | 19.01.2024 | Wayfair Inc, Strike Price \$322.19 ∞ | 1 | 0,00 |
| 200.000 | 19.01.2024 | Wayfair Inc, Strike Price \$323.74 ∞ | 2 | 0,00 |
| 114.629 | 13.05.2024 | Wayfair Inc, Strike Price \$38.47 ∞ | 2.947.678 | 0,18 |
| 818.777 | 25.10.2028 | Wayfair Inc, Strike Price \$73.28 ∞ | 27.918.544 | 1,72 |
| 10 | 21.06.2024 | West Pharmaceutical Services Inc, Strike Price \$430.00 ± | 6.150 | 0,00 |
| 9 | 21.06.2024 | West Pharmaceutical Services Inc, Strike Price \$470.00 ± | 2.182 | 0,00 |
| 41.096 | 07.11.2024 | Western Digital Corp, Strike Price \$42.46 ∞ | 585.085 | 0,04 |
| 100 | 21.06.2024 | Western Digital Corp, Strike Price \$52.50 ± | 56.250 | 0,00 |
| 249.066 | 16.10.2028 | Western Digital Corp, Strike Price \$70.26 ∞ | 3.454.494 | 0,21 |
| 22 | 21.06.2024 | Wingstop Inc, Strike Price \$250.00 ± | 73.590 | 0,01 |
| 19 | 21.06.2024 | Wingstop Inc, Strike Price \$280.00 ± | 36.670 | 0,00 |
| 87 | 19.01.2024 | Winnebago Industries Inc, Strike Price \$65.00 ± | 77.865 | 0,01 |
| 49 | 21.06.2024 | Winnebago Industries Inc, Strike Price \$65.00 ± | 58.065 | 0,01 |
| 81 | 19.01.2024 | Winnebago Industries Inc, Strike Price \$70.00 ± | 30.375 | 0,00 |
| 41 | 21.06.2024 | Winnebago Industries Inc, Strike Price \$70.00 ± | 39.975 | 0,00 |
| 21.739 | 19.10.2029 | Wolfspeed Inc, Strike Price \$107.31 ∞ | 401.080 | 0,03 |
| 120.000 | 19.10.2029 | Wolfspeed Inc, Strike Price \$200.00 ∞ | 1.597.042 | 0,10 |
| 46 | 19.01.2024 | Wyndham Worldwide Corp, Strike Price \$110.00 ± | 506 | 0,00 |
| 42 | 19.01.2024 | Wyndham Worldwide Corp, Strike Price \$115.00 ± | 42 | 0,00 |
| 42 | 19.01.2024 | Wyndham Worldwide Corp, Strike Price \$120.00 ± | 294 | 0,00 |
| 73 | 19.01.2024 | Wyndham Worldwide Corp, Strike Price \$130.00 ± | 0 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/ Nominalwert | Fällig- keit | Art | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|------------------------------------|-----------------|--|------------------|------------------------------|
| Kaufsoptionen (Fortsetzung) | | | | |
| 170.000.000 JPY | 20.06.2024 | Yaoko Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 50bps. [∞] | 415.652 | 0,03 |
| 500.000.000 JPY | 21.05.2024 | Yaoko Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 55bps. [∞] | 1.222.165 | 0,08 |
| Verkaufsoptionen | | | | |
| 50 | 14.06.2024 | 3 Month SOFR Put Option on Future, Strike Price \$94.00 [±] | 1.563 | 0,00 |
| 50 | 14.06.2024 | 3 Month SOFR Put Option on Future, Strike Price \$94.75 [±] | 4.688 | 0,00 |
| 66 | 19.01.2024 | AbbVie Inc, Strike Price \$100.00 [±] | 0 | 0,00 |
| 81 | 21.06.2024 | AbbVie Inc, Strike Price \$105.00 [±] | 4.212 | 0,00 |
| 42 | 19.01.2024 | AbbVie Inc, Strike Price \$110.00 [±] | 0 | 0,00 |
| 47 | 19.01.2024 | AbbVie Inc, Strike Price \$120.00 [±] | 235 | 0,00 |
| 57 | 21.06.2024 | AbbVie Inc, Strike Price \$125.00 [±] | 8.522 | 0,00 |
| 34 | 19.01.2024 | AbbVie Inc, Strike Price \$135.00 [±] | 357 | 0,00 |
| 41 | 21.06.2024 | AbbVie Inc, Strike Price \$150.00 [±] | 25.318 | 0,00 |
| 29 | 19.01.2024 | AbbVie Inc, Strike Price \$160.00 [±] | 20.227 | 0,00 |
| 102 | 19.01.2024 | AbbVie Inc, Strike Price \$80.00 [±] | 0 | 0,00 |
| 15 | 19.01.2024 | Adobe Inc, Strike Price \$260.00 [±] | 0 | 0,00 |
| 12 | 19.01.2024 | Adobe Inc, Strike Price \$320.00 [±] | 24 | 0,00 |
| 11 | 19.01.2024 | Adobe Inc, Strike Price \$370.00 [±] | 33 | 0,00 |
| 159 | 19.04.2024 | Advanced Energy Industries Inc, Strike Price \$80.00 [±] | 25.440 | 0,00 |
| 98 | 21.06.2024 | Advanced Micro Devices Inc, Strike Price \$105.00 [±] | 24.451 | 0,00 |
| 45 | 21.06.2024 | Advanced Micro Devices Inc, Strike Price \$125.00 [±] | 29.700 | 0,00 |
| 105 | 19.01.2024 | Advanced Micro Devices Inc, Strike Price \$60.00 [±] | 105 | 0,00 |
| 66 | 21.06.2024 | Advanced Micro Devices Inc, Strike Price \$75.00 [±] | 3.036 | 0,00 |
| 96 | 21.06.2024 | Advanced Micro Devices Inc, Strike Price \$85.00 [±] | 7.824 | 0,00 |
| 47 | 21.06.2024 | Advanced Micro Devices Inc, Strike Price \$90.00 [±] | 5.100 | 0,00 |
| 77 | 19.01.2024 | AeroVironment Inc, Strike Price \$80.00 [±] | 0 | 0,00 |
| 55 | 19.01.2024 | AeroVironment Inc, Strike Price \$95.00 [±] | 0 | 0,00 |
| 750 | 19.01.2024 | Akamai Technologies Inc, Strike Price \$65.00 [±] | 0 | 0,00 |
| 205 | 16.02.2024 | Akamai Technologies Inc, Strike Price \$75.00 [±] | 2.050 | 0,00 |
| 18 | 19.01.2024 | Align Technology Inc, Strike Price \$240.00 [±] | 1.890 | 0,00 |
| 14.881 | 19.01.2024 | American Airlines Group Inc, Strike Price \$10.00 [±] | 37.202 | 0,00 |
| 4.298 | 17.05.2024 | American Airlines Group Inc, Strike Price \$10.00 [±] | 98.854 | 0,01 |
| 4.815 | 15.03.2024 | American Airlines Group Inc, Strike Price \$8.00 [±] | 57.780 | 0,00 |
| 1.369 | 16.02.2024 | American Airlines Group Inc, Strike Price \$9.00 [±] | 6.845 | 0,00 |
| 7.853 | 17.05.2024 | American Airlines Group Inc, Strike Price \$9.00 [±] | 113.869 | 0,01 |
| 33 | 21.06.2024 | Ameriprise Financial Inc, Strike Price \$230.00 [±] | 1.898 | 0,00 |
| 44 | 21.06.2024 | Ameriprise Financial Inc, Strike Price \$240.00 [±] | 4.620 | 0,00 |
| 24 | 21.06.2024 | Ameriprise Financial Inc, Strike Price \$280.00 [±] | 4.500 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/ Nominalwert | Fällig- keit | Art | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|---------------------------------------|-----------------|--|------------------|------------------------------|
| Verkaufsoptionen (Fortsetzung) | | | | |
| 29 | 21.06.2024 | Ameriprise Financial Inc, Strike Price \$300.00 ± | 8.918 | 0,00 |
| 19 | 21.06.2024 | Ameriprise Financial Inc, Strike Price \$330.00 ± | 12.350 | 0,00 |
| 22 | 21.06.2024 | Ameriprise Financial Inc, Strike Price \$350.00 ± | 24.970 | 0,00 |
| 56.384 | 20.12.2024 | ams AG, Strike Price CHF0.97 ± | 3.055.069 | 0,19 |
| 26.654 | 15.03.2024 | ams AG, Strike Price CHF1.50 ± | 1.061.045 | 0,07 |
| 43 | 19.01.2024 | Analog Devices Inc, Strike Price \$130.00 ± | 645 | 0,00 |
| 35 | 19.01.2024 | Analog Devices Inc, Strike Price \$160.00 ± | 962 | 0,00 |
| 30 | 19.01.2024 | Analog Devices Inc, Strike Price \$190.00 ± | 3.075 | 0,00 |
| 48 | 19.01.2024 | Apellis Pharmaceuticals Inc, Strike Price \$22.50 ± | 840 | 0,00 |
| 45 | 19.01.2024 | Apellis Pharmaceuticals Inc, Strike Price \$30.00 ± | 2.137 | 0,00 |
| 217 | 19.01.2024 | Apple Inc, Strike Price \$105.00 ± | 217 | 0,00 |
| 48 | 19.01.2024 | Apple Inc, Strike Price \$115.00 ± | 48 | 0,00 |
| 154 | 19.01.2024 | Apple Inc, Strike Price \$125.00 ± | 154 | 0,00 |
| 41 | 19.01.2024 | Apple Inc, Strike Price \$135.00 ± | 82 | 0,00 |
| 105 | 19.01.2024 | Apple Inc, Strike Price \$150.00 ± | 420 | 0,00 |
| 35 | 19.01.2024 | Apple Inc, Strike Price \$160.00 ± | 210 | 0,00 |
| 74 | 19.01.2024 | Apple Inc, Strike Price \$180.00 ± | 2.368 | 0,00 |
| 65 | 19.01.2024 | Applied Materials Inc, Strike Price \$100.00 ± | 260 | 0,00 |
| 54 | 19.01.2024 | Applied Materials Inc, Strike Price \$120.00 ± | 324 | 0,00 |
| 79 | 19.01.2024 | Applied Materials Inc, Strike Price \$82.50 ± | 0 | 0,00 |
| 51 | 21.06.2024 | Autodesk Inc, Strike Price \$145.00 ± | 4.080 | 0,00 |
| 52 | 19.01.2024 | Autodesk Inc, Strike Price \$150.00 ± | 0 | 0,00 |
| 60 | 21.06.2024 | Autodesk Inc, Strike Price \$150.00 ± | 4.950 | 0,00 |
| 17 | 19.01.2024 | Autodesk Inc, Strike Price \$160.00 ± | 0 | 0,00 |
| 36 | 19.01.2024 | Autodesk Inc, Strike Price \$180.00 ± | 270 | 0,00 |
| 77 | 21.06.2024 | Autodesk Inc, Strike Price \$180.00 ± | 18.095 | 0,00 |
| 14 | 19.01.2024 | Autodesk Inc, Strike Price \$195.00 ± | 245 | 0,00 |
| 27 | 19.01.2024 | Autodesk Inc, Strike Price \$210.00 ± | 742 | 0,00 |
| 57 | 21.06.2024 | Autodesk Inc, Strike Price \$210.00 ± | 37.050 | 0,00 |
| 12 | 19.01.2024 | Autodesk Inc, Strike Price \$230.00 ± | 1.350 | 0,00 |
| 55 | 19.01.2024 | Axon Enterprise Inc, Strike Price \$140.00 ± | 0 | 0,00 |
| 37 | 19.01.2024 | Axon Enterprise Inc, Strike Price \$170.00 ± | 185 | 0,00 |
| 28 | 19.01.2024 | Axon Enterprise Inc, Strike Price \$200.00 ± | 280 | 0,00 |
| 15.416 | 21.06.2024 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Strike Price EUR3.60 ± | 17.029 | 0,00 |
| 309 | 21.06.2024 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Strike Price EUR3.90 ± | 341 | 0,00 |
| 195 | 21.06.2024 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Strike Price EUR4.50 ± | 646 | 0,00 |
| 4.070 | 21.06.2024 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Strike Price EUR4.70 ± | 17.984 | 0,00 |
| 4.460 | 21.06.2024 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Strike Price EUR5.00 ± | 24.634 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/ Nominalwert | Fällig- keit | Art | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|---------------------------------------|-----------------|--|------------------|------------------------------|
| Verkaufsoptionen (Fortsetzung) | | | | |
| 7.040 | 20.09.2024 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Strike Price EUR5.25 ± | 77.767 | 0,01 |
| 375 | 21.06.2024 | Banco BPM SpA, Strike Price EUR2.20 ± | 7.953 | 0,00 |
| 3.255 | 15.03.2024 | Banco BPM SpA, Strike Price EUR2.50 ± | 36.675 | 0,00 |
| 30.000 | 21.06.2024 | Banco Santander SA, Strike Price EUR2.60 ± | 66.279 | 0,01 |
| 261 | 19.01.2024 | Bath & Body Works Inc, Strike Price \$27.50 ± | 0 | 0,00 |
| 187 | 19.01.2024 | Bath & Body Works Inc, Strike Price \$32.50 ± | 4.675 | 0,00 |
| 124 | 19.01.2024 | Bath & Body Works Inc, Strike Price \$40.00 ± | 5.270 | 0,00 |
| 29 | 21.06.2024 | Berkshire Hathaway Inc, Strike Price \$240.00 ± | 1.131 | 0,00 |
| 20 | 21.06.2024 | Berkshire Hathaway Inc, Strike Price \$290.00 ± | 3.340 | 0,00 |
| 14 | 21.06.2024 | Berkshire Hathaway Inc, Strike Price \$350.00 ± | 12.180 | 0,00 |
| 77 | 19.01.2024 | Best Buy Co Inc, Strike Price \$50.00 ± | 693 | 0,00 |
| 138 | 19.01.2024 | Best Buy Co Inc, Strike Price \$55.00 ± | 414 | 0,00 |
| 45 | 19.01.2024 | Best Buy Co Inc, Strike Price \$60.00 ± | 202 | 0,00 |
| 62 | 19.01.2024 | Best Buy Co Inc, Strike Price \$62.50 ± | 713 | 0,00 |
| 98 | 19.01.2024 | Best Buy Co Inc, Strike Price \$65.00 ± | 490 | 0,00 |
| 88 | 19.01.2024 | Best Buy Co Inc, Strike Price \$75.00 ± | 5.324 | 0,00 |
| 70 | 19.01.2024 | Best Buy Co Inc, Strike Price \$77.50 ± | 9.380 | 0,00 |
| 102 | 19.01.2024 | Best Buy Co Inc, Strike Price \$82.50 ± | 46.155 | 0,00 |
| 31 | 19.01.2024 | Best Buy Co Inc, Strike Price \$87.50 ± | 28.675 | 0,00 |
| 20 | 21.06.2024 | BlackRock Inc, Strike Price \$520.00 ± | 4.900 | 0,00 |
| 14 | 21.06.2024 | BlackRock Inc, Strike Price \$640.00 ± | 8.470 | 0,00 |
| 11 | 21.06.2024 | BlackRock Inc, Strike Price \$750.00 ± | 26.125 | 0,00 |
| 345 | 21.06.2024 | BNP Paribas SA, Strike Price EUR40.00 ± | 13.910 | 0,00 |
| 145 | 17.01.2025 | Boyd Gaming Corp, Strike Price \$45.00 ± | 18.488 | 0,00 |
| 96 | 17.01.2025 | Boyd Gaming Corp, Strike Price \$55.00 ± | 30.240 | 0,00 |
| 70 | 17.01.2025 | Boyd Gaming Corp, Strike Price \$65.00 ± | 42.700 | 0,00 |
| 76 | 19.01.2024 | Boyd Gaming Corp, Strike Price \$70.00 ± | 57.760 | 0,00 |
| 2.202 | 17.05.2024 | Bridgebio Pharma Inc, Strike Price \$20.00 ± | 115.605 | 0,01 |
| 3.520 | 16.02.2024 | Bridgebio Pharma Inc, Strike Price \$22.50 ± | 70.400 | 0,01 |
| 9 | 19.01.2024 | Broadcom Inc, Strike Price \$440.00 ± | 0 | 0,00 |
| 8 | 19.01.2024 | Broadcom Inc, Strike Price \$530.00 ± | 0 | 0,00 |
| 6 | 19.01.2024 | Broadcom Inc, Strike Price \$630.00 ± | 30 | 0,00 |
| 159 | 19.01.2024 | Cardinal Health Inc, Strike Price \$60.00 ± | 0 | 0,00 |
| 236 | 19.01.2024 | Cardinal Health Inc, Strike Price \$65.00 ± | 0 | 0,00 |
| 103 | 19.01.2024 | Cardinal Health Inc, Strike Price \$75.00 ± | 0 | 0,00 |
| 75 | 19.01.2024 | Cardinal Health Inc, Strike Price \$87.50 ± | 1.312 | 0,00 |
| 101 | 17.01.2025 | CarMax Inc, Strike Price \$57.50 ± | 41.915 | 0,00 |
| 68 | 17.01.2025 | CarMax Inc, Strike Price \$70.00 ± | 54.060 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/ Nominalwert | Fällig- keit | Art | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---------------------------------------|-----------------|---|------------------|------------------------------|
| Verkaufsoptionen (Fortsetzung) | | | | |
| 53 | 17.01.2025 | CarMax Inc, Strike Price \$80.00 ± | 65.720 | 0,01 |
| 4.238 | 19.04.2024 | Carnival Corp, Strike Price \$10.00 ± | 40.261 | 0,00 |
| 669 | 19.01.2024 | Carnival Corp, Strike Price \$11.00 ± | 669 | 0,00 |
| 8.640 | 19.04.2024 | Carnival Corp, Strike Price \$11.00 ± | 60.480 | 0,01 |
| 50 | 02.01.2024 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,800.00 ± | 500 | 0,00 |
| 136 | 21.06.2024 | CDW Corp, Strike Price \$150.00 ± | 34.680 | 0,00 |
| 43 | 21.06.2024 | CDW Corp, Strike Price \$180.00 ± | 12.040 | 0,00 |
| 48 | 21.06.2024 | CDW Corp, Strike Price \$185.00 ± | 12.240 | 0,00 |
| 31 | 21.06.2024 | CDW Corp, Strike Price \$210.00 ± | 16.120 | 0,00 |
| 34 | 21.06.2024 | CDW Corp, Strike Price \$220.00 ± | 27.200 | 0,00 |
| 137 | 15.03.2024 | Cellnex Telecom SA, Strike Price EUR25.00 ± | 3.935 | 0,00 |
| 235 | 20.09.2024 | Cellnex Telecom SA, Strike Price EUR25.00 ± | 21.287 | 0,00 |
| 112 | 19.01.2024 | Cencora Inc, Strike Price \$135.00 ± | 0 | 0,00 |
| 52 | 19.01.2024 | Cencora Inc, Strike Price \$150.00 ± | 0 | 0,00 |
| 36 | 19.01.2024 | Cencora Inc, Strike Price \$180.00 ± | 1.440 | 0,00 |
| 137 | 17.01.2025 | Charles Schwab Corp, Strike Price \$42.50 ± | 14.865 | 0,00 |
| 100 | 17.01.2025 | Charles Schwab Corp, Strike Price \$50.00 ± | 21.300 | 0,00 |
| 70 | 17.01.2025 | Charles Schwab Corp, Strike Price \$60.00 ± | 29.575 | 0,00 |
| 284 | 19.01.2024 | Chemours Co, Strike Price \$20.00 ± | 0 | 0,00 |
| 245 | 17.01.2025 | Chemours Co, Strike Price \$23.00 ± | 37.363 | 0,00 |
| 236 | 19.01.2024 | Chemours Co, Strike Price \$24.00 ± | 0 | 0,00 |
| 203 | 19.01.2024 | Chemours Co, Strike Price \$28.00 ± | 5.582 | 0,00 |
| 165 | 17.01.2025 | Chemours Co, Strike Price \$28.00 ± | 49.913 | 0,00 |
| 120 | 17.01.2025 | Chemours Co, Strike Price \$33.00 ± | 64.800 | 0,01 |
| 9 | 19.01.2024 | Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price \$1,120.00 ± | 117 | 0,00 |
| 6 | 21.06.2024 | Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price \$1,300.00 ± | 795 | 0,00 |
| 6 | 19.01.2024 | Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price \$1,430.00 ± | 0 | 0,00 |
| 7 | 19.01.2024 | Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price \$1,440.00 ± | 0 | 0,00 |
| 4 | 21.06.2024 | Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price \$1,570.00 ± | 3.080 | 0,00 |
| 4 | 21.06.2024 | Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price \$1,850.00 ± | 11.540 | 0,00 |
| 1.125 | 21.06.2024 | Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price \$10.00 ± | 9.562 | 0,00 |
| 1.328 | 21.06.2024 | Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price \$13.00 ± | 21.912 | 0,00 |
| 171 | 19.01.2024 | Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price \$15.00 ± | 427 | 0,00 |
| 999 | 21.06.2024 | Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price \$15.00 ± | 35.464 | 0,00 |
| 386 | 21.06.2024 | Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price \$17.00 ± | 28.371 | 0,00 |
| 142 | 19.01.2024 | Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price \$18.00 ± | 852 | 0,00 |
| 128 | 19.01.2024 | Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price \$20.00 ± | 5.248 | 0,00 |
| 219 | 19.01.2024 | Commercial Metals Co, Strike Price \$46.00 ± | 9.307 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/ Nominalwert | Fällig- keit | Art | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|---------------------------------------|-----------------|---|------------------|------------------------------|
| Verkaufsoptionen (Fortsetzung) | | | | |
| 154 | 19.01.2024 | Commercial Metals Co, Strike Price \$55.00 ± | 82.390 | 0,01 |
| 1.000 | 17.05.2024 | CONMED Corp, Strike Price \$80.00 ± | 112.500 | 0,01 |
| 571 | 19.01.2024 | Coty Inc, Strike Price \$10.00 ± | 0 | 0,00 |
| 475 | 19.01.2024 | Coty Inc, Strike Price \$12.00 ± | 7.362 | 0,00 |
| 714 | 19.01.2024 | Coty Inc, Strike Price \$8.00 ± | 0 | 0,00 |
| 584 | 15.03.2024 | Crédit Agricole SA, Strike Price EUR6.00 ± | 645 | 0,00 |
| 10.567 | 21.06.2024 | Crédit Agricole SA, Strike Price EUR6.00 ± | 35.019 | 0,00 |
| 45 | 19.01.2024 | CVS Caremark Corp, Strike Price \$65.00 ± | 135 | 0,00 |
| 39 | 19.01.2024 | CVS Caremark Corp, Strike Price \$75.00 ± | 1.579 | 0,00 |
| 310 | 21.06.2024 | Dave & Buster's Entertainment Inc, Strike Price \$25.00 ± | 12.400 | 0,00 |
| 215 | 21.06.2024 | Dave & Buster's Entertainment Inc, Strike Price \$30.00 ± | 6.988 | 0,00 |
| 160 | 21.06.2024 | Dave & Buster's Entertainment Inc, Strike Price \$35.00 ± | 12.400 | 0,00 |
| 593 | 15.03.2024 | Davide Campari-Milano NV, Strike Price EUR8.60 ± | 25.482 | 0,00 |
| 16.780 | 21.06.2024 | Deutsche Lufthansa AG, Strike Price EUR5.60 ± | 213.164 | 0,01 |
| 1.395.000 | 20.12.2024 | Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR15.50 ∞ | 243.321 | 0,01 |
| 1.395.000 | 21.03.2025 | Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR15.50 ∞ | 361.953 | 0,02 |
| 231 | 19.01.2024 | Devon Energy Corp, Strike Price \$27.00 ± | 0 | 0,00 |
| 237 | 21.06.2024 | Devon Energy Corp, Strike Price \$32.50 ± | 18.368 | 0,00 |
| 143 | 21.06.2024 | Devon Energy Corp, Strike Price \$35.00 ± | 13.657 | 0,00 |
| 155 | 19.01.2024 | Devon Energy Corp, Strike Price \$37.00 ± | 620 | 0,00 |
| 178 | 21.06.2024 | Devon Energy Corp, Strike Price \$37.50 ± | 24.653 | 0,00 |
| 62 | 19.01.2024 | Devon Energy Corp, Strike Price \$42.00 ± | 1.519 | 0,00 |
| 96 | 21.06.2024 | Devon Energy Corp, Strike Price \$42.50 ± | 27.888 | 0,00 |
| 128 | 19.01.2024 | Devon Energy Corp, Strike Price \$45.00 ± | 13.184 | 0,00 |
| 124 | 21.06.2024 | Devon Energy Corp, Strike Price \$45.00 ± | 49.910 | 0,00 |
| 209 | 19.01.2024 | Devon Energy Corp, Strike Price \$50.00 ± | 105.545 | 0,01 |
| 71 | 21.06.2024 | Devon Energy Corp, Strike Price \$50.00 ± | 49.877 | 0,00 |
| 105 | 19.01.2024 | Devon Energy Corp, Strike Price \$55.00 ± | 101.325 | 0,01 |
| 57 | 19.01.2024 | Dexcom Inc, Strike Price \$107.50 ± | 2.850 | 0,00 |
| 88 | 19.01.2024 | Dexcom Inc, Strike Price \$110.00 ± | 6.380 | 0,00 |
| 81 | 19.01.2024 | Dexcom Inc, Strike Price \$90.00 ± | 2.025 | 0,00 |
| 90 | 21.06.2024 | Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price \$110.00 ± | 23.850 | 0,00 |
| 55 | 19.01.2024 | Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price \$115.00 ± | 825 | 0,00 |
| 42 | 21.06.2024 | Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price \$130.00 ± | 28.980 | 0,00 |
| 62 | 19.01.2024 | Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price \$135.00 ± | 3.875 | 0,00 |
| 59 | 21.06.2024 | Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price \$80.00 ± | 6.343 | 0,00 |
| 87 | 21.06.2024 | Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price \$90.00 ± | 7.830 | 0,00 |
| 79 | 19.01.2024 | Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price \$95.00 ± | 395 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/ Nominalwert | Fällig- keit | Art | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|---------------------------------------|-----------------|--|------------------|------------------------------|
| Verkaufsoptionen (Fortsetzung) | | | | |
| 43 | 21.06.2024 | Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price \$95.00 ± | 5.160 | 0,00 |
| 4.500 | 19.01.2024 | DISH Network Corp, Strike Price \$3.00 ± | 4.500 | 0,00 |
| 1.724 | 19.01.2024 | DISH Network Corp, Strike Price \$4.00 ± | 9.482 | 0,00 |
| 755 | 15.03.2024 | DISH Network Corp, Strike Price \$4.00 ± | 20.762 | 0,00 |
| 420 | 21.06.2024 | DISH Network Corp, Strike Price \$5.00 ± | 40.740 | 0,00 |
| 35 | 19.01.2024 | Dollar Tree Inc, Strike Price \$135.00 ± | 2.730 | 0,00 |
| 28 | 19.01.2024 | Domino's Pizza Inc, Strike Price \$220.00 ± | 0 | 0,00 |
| 25 | 19.01.2024 | Domino's Pizza Inc, Strike Price \$260.00 ± | 0 | 0,00 |
| 21 | 19.01.2024 | Domino's Pizza Inc, Strike Price \$310.00 ± | 336 | 0,00 |
| 74 | 19.01.2024 | Eagle Materials Inc, Strike Price \$120.00 ± | 0 | 0,00 |
| 939 | 19.04.2024 | Enovis Corporation, Strike Price \$30.00 ± | 16.433 | 0,00 |
| 1.665 | 16.02.2024 | Envestnet Inc, Strike Price \$35.00 ± | 112.387 | 0,01 |
| 378 | 19.01.2024 | EQT Corp, Strike Price \$29.00 ± | 1.134 | 0,00 |
| 173 | 21.06.2024 | EQT Corp, Strike Price \$30.00 ± | 15.397 | 0,00 |
| 97 | 21.06.2024 | EQT Corp, Strike Price \$40.00 ± | 41.468 | 0,00 |
| 77 | 21.06.2024 | EQT Corp, Strike Price \$45.00 ± | 59.098 | 0,01 |
| 2.670 | 21.06.2024 | Erste Group Bank AG, Strike Price EUR20.00 ± | 45.716 | 0,00 |
| 1.115 | 21.06.2024 | Erste Group Bank AG, Strike Price EUR22.00 ± | 21.554 | 0,00 |
| 89 | 19.01.2024 | Etsy Inc, Strike Price \$65.00 ± | 1.246 | 0,00 |
| 72 | 19.01.2024 | Etsy Inc, Strike Price \$80.00 ± | 19.188 | 0,00 |
| 238 | 19.01.2024 | Euro Stoxx 50 Index, Strike Price EUR4,350.00 ± | 22.610 | 0,00 |
| 338 | 19.01.2024 | Euro Stoxx 50 Index, Strike Price EUR4,525.00 ± | 185.939 | 0,01 |
| 3.000.000 EUR | 18.01.2024 | Euro/United States Dollar Currency Option, Strike Price 1.00 ∞ | 0 | 0,00 |
| 11 | 21.06.2024 | Fair Isaac Corp, Strike Price \$600.00 ± | 3.135 | 0,00 |
| 6 | 21.06.2024 | Fair Isaac Corp, Strike Price \$720.00 ± | 3.045 | 0,00 |
| 6 | 21.06.2024 | Fair Isaac Corp, Strike Price \$850.00 ± | 8.520 | 0,00 |
| 25 | 19.01.2024 | FedEx Corp, Strike Price \$155.00 ± | 50 | 0,00 |
| 39 | 19.01.2024 | FedEx Corp, Strike Price \$160.00 ± | 78 | 0,00 |
| 37 | 17.01.2025 | FedEx Corp, Strike Price \$175.00 ± | 14.615 | 0,00 |
| 44 | 21.06.2024 | FedEx Corp, Strike Price \$180.00 ± | 4.268 | 0,00 |
| 21 | 19.01.2024 | FedEx Corp, Strike Price \$185.00 ± | 63 | 0,00 |
| 32 | 21.06.2024 | FedEx Corp, Strike Price \$185.00 ± | 3.840 | 0,00 |
| 34 | 19.01.2024 | FedEx Corp, Strike Price \$190.00 ± | 136 | 0,00 |
| 18 | 19.01.2024 | FedEx Corp, Strike Price \$220.00 ± | 306 | 0,00 |
| 53 | 21.06.2024 | FedEx Corp, Strike Price \$220.00 ± | 25.837 | 0,00 |
| 24 | 17.01.2025 | FedEx Corp, Strike Price \$220.00 ± | 28.500 | 0,00 |
| 28 | 19.01.2024 | FedEx Corp, Strike Price \$230.00 ± | 644 | 0,00 |
| 19 | 17.01.2025 | FedEx Corp, Strike Price \$250.00 ± | 42.608 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/ Nominalwert | Fällig- keit | Art | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|---------------------------------------|-----------------|--|------------------|------------------------------|
| Verkaufsoptionen (Fortsetzung) | | | | |
| 38 | 21.06.2024 | FedEx Corp, Strike Price \$260.00 ± | 69.920 | 0,01 |
| 56 | 19.01.2024 | Five Below Inc, Strike Price \$135.00 ± | 0 | 0,00 |
| 1.125 | 19.01.2024 | Fluor Corp, Strike Price \$25.00 ± | 0 | 0,00 |
| 80 | 19.01.2024 | Foot Locker Inc, Strike Price \$32.50 ± | 15.600 | 0,00 |
| 183 | 19.01.2024 | Fortinet Inc, Strike Price \$37.00 ± | 0 | 0,00 |
| 347 | 21.06.2024 | Freeport-McMoRan Inc, Strike Price \$25.00 ± | 4.164 | 0,00 |
| 200 | 21.06.2024 | Freeport-McMoRan Inc, Strike Price \$33.00 ± | 15.200 | 0,00 |
| 152 | 21.06.2024 | Freeport-McMoRan Inc, Strike Price \$38.00 ± | 28.348 | 0,00 |
| 161 | 21.06.2024 | Halliburton Co, Strike Price \$30.00 ± | 15.617 | 0,00 |
| 108 | 21.06.2024 | Halliburton Co, Strike Price \$37.00 ± | 37.260 | 0,00 |
| 83 | 21.06.2024 | Halliburton Co, Strike Price \$42.00 ± | 55.610 | 0,00 |
| 7.296 | 15.03.2024 | Herbalife Nutrition Ltd, Strike Price \$7.50 ± | 127.680 | 0,01 |
| 34 | 19.01.2024 | Hess Corp, Strike Price \$110.00 ± | 0 | 0,00 |
| 30 | 19.01.2024 | Hess Corp, Strike Price \$125.00 ± | 3.300 | 0,00 |
| 42 | 19.01.2024 | Hess Corp, Strike Price \$90.00 ± | 0 | 0,00 |
| 81 | 19.01.2024 | Hess Corp, Strike Price \$92.50 ± | 0 | 0,00 |
| 122 | 19.01.2024 | Hess Corp, Strike Price \$97.50 ± | 610 | 0,00 |
| 369 | 19.01.2024 | HP Inc, Strike Price \$18.00 ± | 0 | 0,00 |
| 4.432 | 15.03.2024 | Idorsia Ltd, Strike Price CHF1.40 ± | 210.634 | 0,01 |
| 10.248 | 15.03.2024 | Idorsia Ltd, Strike Price CHF1.80 ± | 657.508 | 0,04 |
| 6.133 | 15.03.2024 | Idorsia Ltd, Strike Price CHF2.20 ± | 546.516 | 0,04 |
| 165 | 19.01.2024 | Insulet Corp, Strike Price \$130.00 ± | 31.350 | 0,00 |
| 200 | 15.03.2024 | InterDigital Inc, Strike Price \$55.00 ± | 0 | 0,00 |
| 5.360 | 15.03.2024 | International Consolidated Airlines Group SA, Strike Price GBP100.00 ± | 17.082 | 0,00 |
| 240 | 21.06.2024 | Intesa Sanpaolo SpA, Strike Price EUR1.00 ± | 2.174 | 0,00 |
| 400 | 21.06.2024 | Intesa Sanpaolo SpA, Strike Price EUR1.20 ± | 3.977 | 0,00 |
| 16.954 | 21.06.2024 | Intesa Sanpaolo SpA, Strike Price EUR1.40 ± | 181.664 | 0,01 |
| 162 | 19.01.2024 | ITT Inc, Strike Price \$45.00 ± | 0 | 0,00 |
| 111 | 19.01.2024 | ITT Inc, Strike Price \$55.00 ± | 0 | 0,00 |
| 216 | 19.01.2024 | ITT Inc, Strike Price \$65.00 ± | 0 | 0,00 |
| 68 | 19.01.2024 | ITT Inc, Strike Price \$70.00 ± | 0 | 0,00 |
| 169 | 11.01.2024 | KOSPI 200 Index, Strike Price KRW320.00 ± | 2.624 | 0,00 |
| 101 | 19.01.2024 | Kroger Co, Strike Price \$30.00 ± | 0 | 0,00 |
| 607 | 19.01.2024 | Kroger Co, Strike Price \$33.00 ± | 0 | 0,00 |
| 125 | 19.01.2024 | Kroger Co, Strike Price \$35.00 ± | 125 | 0,00 |
| 80 | 19.01.2024 | Kroger Co, Strike Price \$38.00 ± | 160 | 0,00 |
| 166 | 19.01.2024 | Kroger Co, Strike Price \$41.00 ± | 498 | 0,00 |
| 104 | 19.01.2024 | Kroger Co, Strike Price \$42.00 ± | 572 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/ Nominalwert | Fällig- keit | Art | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|---------------------------------------|-----------------|---|------------------|------------------------------|
| Verkaufsoptionen (Fortsetzung) | | | | |
| 68 | 19.01.2024 | Kroger Co, Strike Price \$45.00 ± | 2.754 | 0,00 |
| 143 | 19.01.2024 | Kroger Co, Strike Price \$48.00 ± | 33.033 | 0,00 |
| 87 | 19.01.2024 | Kroger Co, Strike Price \$50.00 ± | 36.757 | 0,00 |
| 52.655 | 13.06.2024 | L&F Co Ltd, Strike Price KRW143,850.00 ∞ | 727.616 | 0,05 |
| 27 | 19.01.2024 | Lam Research Corp, Strike Price \$350.00 ± | 0 | 0,00 |
| 9 | 19.01.2024 | Lam Research Corp, Strike Price \$420.00 ± | 0 | 0,00 |
| 13 | 19.01.2024 | Lam Research Corp, Strike Price \$430.00 ± | 0 | 0,00 |
| 8 | 19.01.2024 | Lam Research Corp, Strike Price \$500.00 ± | 72 | 0,00 |
| 11 | 19.01.2024 | Lam Research Corp, Strike Price \$510.00 ± | 313 | 0,00 |
| 175 | 19.01.2024 | Las Vegas Sands Corp, Strike Price \$42.00 ± | 1.225 | 0,00 |
| 123 | 19.01.2024 | Las Vegas Sands Corp, Strike Price \$50.00 ± | 21.217 | 0,00 |
| 228 | 15.03.2024 | Live Nation Entertainment Inc, Strike Price \$55.00 ± | 9.120 | 0,00 |
| 3.581 | 15.03.2024 | Live Nation Entertainment Inc, Strike Price \$65.00 ± | 170.097 | 0,01 |
| 199 | 19.01.2024 | Live Nation Entertainment Inc, Strike Price \$75.00 ± | 1.990 | 0,00 |
| 6.912 | 21.06.2024 | Lloyds Banking Group Plc, Strike Price GBP20.00 ± | 0 | 0,00 |
| 11.810 | 21.06.2024 | Lloyds Banking Group Plc, Strike Price GBP24.00 ± | 0 | 0,00 |
| 201 | 19.01.2024 | Louisiana-Pacific Corp, Strike Price \$32.50 ± | 0 | 0,00 |
| 118 | 19.01.2024 | Louisiana-Pacific Corp, Strike Price \$42.50 ± | 0 | 0,00 |
| 84 | 19.01.2024 | Louisiana-Pacific Corp, Strike Price \$50.00 ± | 630 | 0,00 |
| 60 | 19.01.2024 | Louisiana-Pacific Corp, Strike Price \$60.00 ± | 540 | 0,00 |
| 57 | 21.06.2024 | Lowe's Companies Inc, Strike Price \$140.00 ± | 2.793 | 0,00 |
| 39 | 21.06.2024 | Lowe's Companies Inc, Strike Price \$170.00 ± | 6.045 | 0,00 |
| 28 | 21.06.2024 | Lowe's Companies Inc, Strike Price \$200.00 ± | 14.840 | 0,00 |
| 32 | 19.01.2024 | Lululemon Athletica Inc, Strike Price \$260.00 ± | 0 | 0,00 |
| 22 | 19.01.2024 | Lululemon Athletica Inc, Strike Price \$320.00 ± | 77 | 0,00 |
| 15 | 19.01.2024 | Lululemon Athletica Inc, Strike Price \$380.00 ± | 202 | 0,00 |
| 82 | 19.01.2024 | LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$64.80 ± | 0 | 0,00 |
| 113 | 21.06.2024 | LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$65.00 ± | 2.825 | 0,00 |
| 67 | 19.01.2024 | LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$79.80 ± | 0 | 0,00 |
| 75 | 21.06.2024 | LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$80.00 ± | 11.625 | 0,00 |
| 60 | 19.01.2024 | LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$89.80 ± | 2.400 | 0,00 |
| 54 | 21.06.2024 | LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$95.00 ± | 31.320 | 0,00 |
| 429 | 19.01.2024 | Marathon Oil Corp, Strike Price \$16.00 ± | 0 | 0,00 |
| 658 | 19.01.2024 | Marathon Oil Corp, Strike Price \$17.00 ± | 1.974 | 0,00 |
| 438 | 21.06.2024 | Marathon Oil Corp, Strike Price \$18.00 ± | 17.082 | 0,00 |
| 294 | 21.06.2024 | Marathon Oil Corp, Strike Price \$22.00 ± | 36.750 | 0,00 |
| 228 | 21.06.2024 | Marathon Oil Corp, Strike Price \$25.00 ± | 58.482 | 0,01 |
| 696 | 19.04.2024 | Marriott Vacations Worldwide Corp, Strike Price \$80.00 ± | 431.520 | 0,03 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/ Nominalwert | Fällig- keit | Art | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|---------------------------------------|-----------------|---|------------------|------------------------------|
| Verkaufsoptionen (Fortsetzung) | | | | |
| 2.493.838 | 27.06.2024 | Meituan, Strike Price HKD74.20 ^{oo} | 1.865.008 | 0,12 |
| 27 | 21.06.2024 | Meta Platforms Inc, Strike Price \$200.00 [±] | 3.564 | 0,00 |
| 32 | 21.06.2024 | Meta Platforms Inc, Strike Price \$225.00 [±] | 7.440 | 0,00 |
| 36 | 21.06.2024 | Meta Platforms Inc, Strike Price \$235.00 [±] | 10.512 | 0,00 |
| 20 | 21.06.2024 | Meta Platforms Inc, Strike Price \$240.00 [±] | 6.500 | 0,00 |
| 24 | 21.06.2024 | Meta Platforms Inc, Strike Price \$270.00 [±] | 15.060 | 0,00 |
| 25 | 21.06.2024 | Meta Platforms Inc, Strike Price \$280.00 [±] | 19.438 | 0,00 |
| 13 | 21.06.2024 | Meta Platforms Inc, Strike Price \$285.00 [±] | 11.213 | 0,00 |
| 18 | 21.06.2024 | Meta Platforms Inc, Strike Price \$320.00 [±] | 30.465 | 0,00 |
| 19 | 21.06.2024 | Meta Platforms Inc, Strike Price \$330.00 [±] | 38.428 | 0,00 |
| 71 | 16.10.2024 | Metlife Inc, Strike Price \$71.00 [±] | 52.402 | 0,00 |
| 71 | 17.10.2024 | Metlife Inc, Strike Price \$71.00 [±] | 52.432 | 0,00 |
| 71 | 18.10.2024 | Metlife Inc, Strike Price \$71.00 [±] | 52.473 | 0,00 |
| 130 | 21.06.2024 | Microchip Technology Inc, Strike Price \$55.00 [±] | 5.850 | 0,00 |
| 88 | 21.06.2024 | Microchip Technology Inc, Strike Price \$67.50 [±] | 9.900 | 0,00 |
| 63 | 21.06.2024 | Microchip Technology Inc, Strike Price \$80.00 [±] | 21.735 | 0,00 |
| 89 | 19.01.2024 | Micron Technology Inc, Strike Price \$45.00 [±] | 178 | 0,00 |
| 153 | 21.06.2024 | Micron Technology Inc, Strike Price \$47.50 [±] | 3.366 | 0,00 |
| 76 | 19.01.2024 | Micron Technology Inc, Strike Price \$52.50 [±] | 988 | 0,00 |
| 163 | 21.06.2024 | Micron Technology Inc, Strike Price \$52.50 [±] | 5.868 | 0,00 |
| 151 | 21.06.2024 | Micron Technology Inc, Strike Price \$55.00 [±] | 6.946 | 0,00 |
| 97 | 21.06.2024 | Micron Technology Inc, Strike Price \$60.00 [±] | 7.469 | 0,00 |
| 63 | 19.01.2024 | Micron Technology Inc, Strike Price \$62.50 [±] | 126 | 0,00 |
| 108 | 21.06.2024 | Micron Technology Inc, Strike Price \$65.00 [±] | 13.608 | 0,00 |
| 100 | 21.06.2024 | Micron Technology Inc, Strike Price \$67.50 [±] | 15.950 | 0,00 |
| 72 | 21.06.2024 | Micron Technology Inc, Strike Price \$70.00 [±] | 14.508 | 0,00 |
| 153 | 21.06.2024 | Micron Technology Inc, Strike Price \$77.50 [±] | 58.905 | 0,01 |
| 600 | 15.03.2024 | Middleby Corp, Strike Price \$95.00 [±] | 13.500 | 0,00 |
| 70 | 15.03.2024 | Nasdaq 100 E-mini Put Option on Future, Strike Price \$16,000.00 [±] | 276.850 | 0,02 |
| 128 | 15.03.2024 | Nasdaq 100 E-mini Put Option on Future, Strike Price \$16,500.00 [±] | 794.240 | 0,05 |
| 11.505 | 21.06.2024 | Natwest Group Plc, Strike Price GBP120.00 [±] | 36.666 | 0,00 |
| 234 | 19.01.2024 | NetApp Inc, Strike Price \$55.00 [±] | 0 | 0,00 |
| 19 | 21.06.2024 | Netflix Inc, Strike Price \$280.00 [±] | 3.410 | 0,00 |
| 20 | 17.01.2025 | Netflix Inc, Strike Price \$310.00 [±] | 23.000 | 0,00 |
| 26 | 21.06.2024 | Netflix Inc, Strike Price \$330.00 [±] | 11.375 | 0,00 |
| 13 | 21.06.2024 | Netflix Inc, Strike Price \$340.00 [±] | 6.760 | 0,00 |
| 14 | 17.01.2025 | Netflix Inc, Strike Price \$380.00 [±] | 33.880 | 0,00 |
| 10 | 21.06.2024 | Netflix Inc, Strike Price \$400.00 [±] | 13.500 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/ Nominalwert | Fällig- keit | Art | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|---------------------------------------|-----------------|--|------------------|------------------------------|
| Verkaufsoptionen (Fortsetzung) | | | | |
| 19 | 21.06.2024 | Netflix Inc, Strike Price \$405.00 ± | 27.503 | 0,00 |
| 11 | 17.01.2025 | Netflix Inc, Strike Price \$440.00 ± | 44.385 | 0,00 |
| 13 | 21.06.2024 | Netflix Inc, Strike Price \$475.00 ± | 47.223 | 0,00 |
| 55 | 21.06.2024 | Neurocrine Biosciences Inc, Strike Price \$110.00 ± | 12.650 | 0,00 |
| 117 | 21.06.2024 | Neurocrine Biosciences Inc, Strike Price \$75.00 ± | 4.973 | 0,00 |
| 73 | 21.06.2024 | Neurocrine Biosciences Inc, Strike Price \$95.00 ± | 6.753 | 0,00 |
| 4.995 | 15.03.2024 | Nexi SpA, Strike Price EUR4.40 ± | 30.072 | 0,00 |
| 259 | 12.01.2024 | Nikkei 225 Index, Strike Price JPY32,250.00 ± | 112.066 | 0,01 |
| 135 | 12.01.2024 | Nikkei 225 Index, Strike Price JPY32,750.00 ± | 119.698 | 0,01 |
| 3.781 | 16.02.2024 | NIO Inc, Strike Price \$6.00 ± | 30.248 | 0,00 |
| 12.802 | 17.05.2024 | NIO Inc, Strike Price \$6.00 ± | 441.669 | 0,03 |
| 909 | 21.06.2024 | NIO Inc, Strike Price \$7.50 ± | 80.447 | 0,01 |
| 6.081 | 15.03.2024 | Norwegian Cruise Line Holdings Ltd, Strike Price \$11.00 ± | 112.499 | 0,01 |
| 3.466 | 15.03.2024 | Norwegian Cruise Line Holdings Ltd, Strike Price \$12.00 ± | 71.053 | 0,01 |
| 266 | 17.05.2024 | Norwegian Cruise Line Holdings Ltd, Strike Price \$12.50 ± | 5.586 | 0,00 |
| 81 | 21.06.2024 | Nucor Corp, Strike Price \$110.00 ± | 4.982 | 0,00 |
| 55 | 21.06.2024 | Nucor Corp, Strike Price \$135.00 ± | 11.110 | 0,00 |
| 42 | 21.06.2024 | Nucor Corp, Strike Price \$155.00 ± | 22.890 | 0,00 |
| 37 | 19.01.2024 | NVIDIA Corp, Strike Price \$170.00 ± | 74 | 0,00 |
| 24 | 19.01.2024 | NVIDIA Corp, Strike Price \$215.00 ± | 24 | 0,00 |
| 16 | 19.01.2024 | NVIDIA Corp, Strike Price \$260.00 ± | 16 | 0,00 |
| 147 | 15.03.2024 | Ocado Group Plc, Strike Price GBP460.00 ± | 29.515 | 0,00 |
| 109 | 15.03.2024 | Ocado Group Plc, Strike Price GBP520.00 ± | 30.917 | 0,00 |
| 440 | 19.01.2024 | Okta Inc, Strike Price \$80.00 ± | 17.600 | 0,00 |
| 870 | 21.06.2024 | ON Semiconductor Corp, Strike Price \$45.00 ± | 73.080 | 0,01 |
| 40 | 19.01.2024 | ON Semiconductor Corp, Strike Price \$85.00 ± | 13.700 | 0,00 |
| 196 | 19.01.2024 | ONEOK Inc, Strike Price \$42.50 ± | 0 | 0,00 |
| 201 | 21.06.2024 | ONEOK Inc, Strike Price \$47.50 ± | 0 | 0,00 |
| 128 | 19.01.2024 | ONEOK Inc, Strike Price \$52.50 ± | 640 | 0,00 |
| 138 | 21.06.2024 | ONEOK Inc, Strike Price \$57.50 ± | 11.040 | 0,00 |
| 99 | 19.01.2024 | ONEOK Inc, Strike Price \$60.00 ± | 99 | 0,00 |
| 101 | 21.06.2024 | ONEOK Inc, Strike Price \$67.50 ± | 32.320 | 0,00 |
| 314 | 15.03.2024 | Ormat Technologies Inc, Strike Price \$45.00 ± | 75.360 | 0,01 |
| 290 | 15.03.2024 | Ormat Technologies Inc, Strike Price \$60.00 ± | 26.100 | 0,00 |
| 750.000 | 21.11.2025 | Palo Alto Networks Inc, Strike Price \$136.16 ± | 3.677.696 | 0,23 |
| 3.062 | 19.01.2024 | Peabody Energy Corp, Strike Price \$14.00 ± | 0 | 0,00 |
| 4.363 | 19.01.2024 | Peabody Energy Corp, Strike Price \$16.00 ± | 0 | 0,00 |
| 2.185 | 19.04.2024 | Peabody Energy Corp, Strike Price \$16.00 ± | 37.145 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/ Nominalwert | Fällig- keit | Art | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|---------------------------------------|-----------------|---|------------------|------------------------------|
| Verkaufsoptionen (Fortsetzung) | | | | |
| 550 | 19.01.2024 | PG&E Corp, Strike Price \$11.00 ± | 0 | 0,00 |
| 1.695 | 19.01.2024 | PG&E Corp, Strike Price \$12.00 ± | 0 | 0,00 |
| 604 | 17.01.2025 | PG&E Corp, Strike Price \$12.00 ± | 22.650 | 0,00 |
| 838 | 19.01.2024 | PG&E Corp, Strike Price \$15.00 ± | 2.514 | 0,00 |
| 388 | 17.01.2025 | PG&E Corp, Strike Price \$15.00 ± | 28.906 | 0,00 |
| 740 | 19.01.2024 | PG&E Corp, Strike Price \$17.00 ± | 5.920 | 0,00 |
| 302 | 17.01.2025 | PG&E Corp, Strike Price \$17.00 ± | 38.354 | 0,00 |
| 820 | 19.01.2024 | PG&E Corp, Strike Price \$9.00 ± | 0 | 0,00 |
| 40 | 19.01.2024 | Pioneer Natural Resources Co, Strike Price \$155.00 ± | 0 | 0,00 |
| 33 | 19.01.2024 | Pioneer Natural Resources Co, Strike Price \$190.00 ± | 660 | 0,00 |
| 28 | 19.01.2024 | Pioneer Natural Resources Co, Strike Price \$220.00 ± | 5.950 | 0,00 |
| 739 | 17.07.2024 | POSCO Holdings Inc, Strike Price KR₩341,600.00 ∞ | 2.823 | 0,00 |
| 16.000.000 | 27.03.2024 | Postal Savings Bank of China Co Ltd, Strike Price HKD2.80 ∞ | 20.613 | 0,00 |
| 1.416 | 19.01.2024 | PPL Corporation, Strike Price \$19.00 ± | 0 | 0,00 |
| 140 | 19.01.2024 | PPL Corporation, Strike Price \$20.00 ± | 0 | 0,00 |
| 124 | 21.06.2024 | Prudential Financial Inc, Strike Price \$70.00 ± | 3.720 | 0,00 |
| 90 | 21.06.2024 | Prudential Financial Inc, Strike Price \$82.50 ± | 9.450 | 0,00 |
| 64 | 21.06.2024 | Prudential Financial Inc, Strike Price \$97.50 ± | 24.320 | 0,00 |
| 109 | 19.01.2024 | Qorvo Inc, Strike Price \$70.00 ± | 0 | 0,00 |
| 74 | 19.01.2024 | Qorvo Inc, Strike Price \$85.00 ± | 1.036 | 0,00 |
| 45 | 21.06.2024 | Ralph Lauren Corp, Strike Price \$115.00 ± | 9.563 | 0,00 |
| 68 | 19.01.2024 | Ralph Lauren Corp, Strike Price \$130.00 ± | 1.700 | 0,00 |
| 92 | 21.06.2024 | Ralph Lauren Corp, Strike Price \$80.00 ± | 4.370 | 0,00 |
| 64 | 21.06.2024 | Ralph Lauren Corp, Strike Price \$95.00 ± | 4.000 | 0,00 |
| 389 | 19.01.2024 | Range Resources Corp, Strike Price \$18.00 ± | 0 | 0,00 |
| 261 | 19.01.2024 | Range Resources Corp, Strike Price \$22.00 ± | 0 | 0,00 |
| 680 | 21.06.2024 | Range Resources Corp, Strike Price \$23.00 ± | 47.600 | 0,00 |
| 188 | 21.06.2024 | Range Resources Corp, Strike Price \$25.00 ± | 20.680 | 0,00 |
| 187 | 19.01.2024 | Range Resources Corp, Strike Price \$26.00 ± | 1.870 | 0,00 |
| 238 | 21.06.2024 | Range Resources Corp, Strike Price \$27.00 ± | 38.080 | 0,00 |
| 236 | 21.06.2024 | Range Resources Corp, Strike Price \$28.00 ± | 45.430 | 0,00 |
| 130 | 21.06.2024 | Range Resources Corp, Strike Price \$30.00 ± | 35.750 | 0,00 |
| 170 | 21.06.2024 | Range Resources Corp, Strike Price \$32.00 ± | 64.600 | 0,01 |
| 172 | 21.06.2024 | Range Resources Corp, Strike Price \$33.00 ± | 75.680 | 0,01 |
| 96 | 21.06.2024 | Range Resources Corp, Strike Price \$35.00 ± | 54.720 | 0,00 |
| 34 | 19.01.2024 | RH, Strike Price \$175.00 ± | 0 | 0,00 |
| 38 | 19.01.2024 | RH, Strike Price \$195.00 ± | 380 | 0,00 |
| 29 | 19.01.2024 | RH, Strike Price \$210.00 ± | 507 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/ Nominalwert | Fällig- keit | Art | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|---------------------------------------|-----------------|--|------------------|------------------------------|
| Verkaufsoptionen (Fortsetzung) | | | | |
| 27 | 19.01.2024 | RH, Strike Price \$230.00 ± | 1.147 | 0,00 |
| 25 | 19.01.2024 | RH, Strike Price \$250.00 ± | 2.937 | 0,00 |
| 20 | 21.06.2024 | RH, Strike Price \$250.00 ± | 35.800 | 0,00 |
| 18 | 19.01.2024 | RH, Strike Price \$280.00 ± | 11.700 | 0,00 |
| 14 | 21.06.2024 | RH, Strike Price \$300.00 ± | 55.440 | 0,00 |
| 12 | 21.06.2024 | RH, Strike Price \$350.00 ± | 85.680 | 0,01 |
| 280 | 15.03.2024 | Rheinmetall AG, Strike Price EUR170.00 ± | 18.713 | 0,00 |
| 555 | 21.06.2024 | Rheinmetall AG, Strike Price EUR200.00 ± | 167.065 | 0,01 |
| 4.170 | 15.03.2024 | Rivian Automotive Inc, Strike Price \$12.50 ± | 64.635 | 0,01 |
| 701 | 15.03.2024 | S&P 500 E-mini Put Option on Future, Strike Price \$4,350.00 ± | 665.950 | 0,04 |
| 140 | 15.03.2024 | S&P 500 E-mini Put Option on Future, Strike Price \$4,400.00 ± | 154.000 | 0,01 |
| 196 | 16.02.2024 | S&P 500 E-mini Put Option on Future, Strike Price \$4,500.00 ± | 151.900 | 0,01 |
| 131 | 15.03.2024 | S&P 500 E-mini Put Option on Future, Strike Price \$4,500.00 ± | 199.775 | 0,01 |
| 230 | 15.03.2024 | S&P 500 E-mini Put Option on Future, Strike Price \$4,550.00 ± | 419.750 | 0,03 |
| 151 | 15.03.2024 | S&P 500 E-mini Put Option on Future, Strike Price \$4,600.00 ± | 332.200 | 0,02 |
| 2 | 19.01.2024 | S&P 500 E-mini Put Option on Future, Strike Price \$4,620.00 ± | 635 | 0,00 |
| 173 | 15.03.2024 | S&P 500 E-mini Put Option on Future, Strike Price \$4,650.00 ± | 456.288 | 0,03 |
| 4 | 15.03.2024 | S&P 500 E-mini Put Option on Future, Strike Price \$4,800.00 ± | 18.850 | 0,00 |
| 1 | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,740.00 ± | 2.760 | 0,00 |
| 1 | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,770.00 ± | 3.790 | 0,00 |
| 502 | 21.06.2024 | Saipem SpA, Strike Price EUR1.00 ± | 18.743 | 0,00 |
| 190 | 20.09.2024 | Saipem SpA, Strike Price EUR1.00 ± | 8.878 | 0,00 |
| 4.653 | 15.03.2024 | Seagate Technology Holdings Plc, Strike Price \$42.50 ± | 137.264 | 0,01 |
| 750 | 15.03.2024 | Semtech Corp, Strike Price \$15.00 ± | 22.500 | 0,00 |
| 17 | 19.01.2024 | ServiceNow Inc, Strike Price \$310.00 ± | 0 | 0,00 |
| 14 | 19.01.2024 | ServiceNow Inc, Strike Price \$370.00 ± | 0 | 0,00 |
| 19 | 21.06.2024 | ServiceNow Inc, Strike Price \$400.00 ± | 5.035 | 0,00 |
| 12 | 19.01.2024 | ServiceNow Inc, Strike Price \$440.00 ± | 0 | 0,00 |
| 19 | 21.06.2024 | ServiceNow Inc, Strike Price \$470.00 ± | 9.405 | 0,00 |
| 33 | 21.06.2024 | ServiceNow Inc, Strike Price \$480.00 ± | 13.943 | 0,00 |
| 11 | 21.06.2024 | ServiceNow Inc, Strike Price \$560.00 ± | 12.870 | 0,00 |
| 14 | 21.06.2024 | ServiceNow Inc, Strike Price \$570.00 ± | 17.430 | 0,00 |
| 13 | 21.06.2024 | ServiceNow Inc, Strike Price \$580.00 ± | 19.630 | 0,00 |
| 10 | 21.06.2024 | ServiceNow Inc, Strike Price \$670.00 ± | 38.650 | 0,00 |
| 11 | 21.06.2024 | ServiceNow Inc, Strike Price \$680.00 ± | 47.685 | 0,00 |
| 37 | 19.01.2024 | Sherwin-Williams Co, Strike Price \$165.00 ± | 0 | 0,00 |
| 31 | 19.01.2024 | Sherwin-Williams Co, Strike Price \$200.00 ± | 310 | 0,00 |
| 26 | 19.01.2024 | Sherwin-Williams Co, Strike Price \$240.00 ± | 130 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/ Nominalwert | Fällig- keit | Art | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|---------------------------------------|-----------------|---|------------------|------------------------------|
| Verkaufsoptionen (Fortsetzung) | | | | |
| 130 | 19.04.2024 | Shift4 Payments Inc, Strike Price \$30.00 ± | 5.200 | 0,00 |
| 34 | 19.04.2024 | Shift4 Payments Inc, Strike Price \$35.00 ± | 0 | 0,00 |
| 391 | 19.01.2024 | Shift4 Payments Inc, Strike Price \$40.00 ± | 1.564 | 0,00 |
| 86 | 19.04.2024 | Shift4 Payments Inc, Strike Price \$45.00 ± | 19.780 | 0,00 |
| 54 | 19.01.2024 | Shift4 Payments Inc, Strike Price \$50.00 ± | 324 | 0,00 |
| 625 | 19.04.2024 | Shift4 Payments Inc, Strike Price \$50.00 ± | 68.750 | 0,01 |
| 912 | 19.01.2024 | Shift4 Payments Inc, Strike Price \$65.00 ± | 38.760 | 0,00 |
| 2.090 | 19.07.2024 | Shift4 Payments Inc, Strike Price \$67.88 ∞ | 1.236.314 | 0,08 |
| 7.007 | 19.07.2024 | Sibanye Stillwater Ltd, Strike Price \$2.50 ± | 0 | 0,00 |
| 5.332 | 21.06.2024 | Siemens Energy AG, Strike Price EUR10.00 ± | 412.300 | 0,03 |
| 14.040 | 20.12.2024 | Siemens Energy AG, Strike Price EUR10.00 ± | 1.822.341 | 0,11 |
| 398 | 21.06.2024 | Siemens Energy AG, Strike Price EUR5.20 ± | 3.957 | 0,00 |
| 930 | 20.09.2024 | Siemens Energy AG, Strike Price EUR5.20 ± | 15.924 | 0,00 |
| 1.833 | 21.06.2024 | Siemens Energy AG, Strike Price EUR6.00 ± | 33.410 | 0,00 |
| 86 | 21.06.2024 | Signet Jewelers Ltd, Strike Price \$55.00 ± | 7.310 | 0,00 |
| 62 | 21.06.2024 | Signet Jewelers Ltd, Strike Price \$65.00 ± | 9.145 | 0,00 |
| 47 | 21.06.2024 | Signet Jewelers Ltd, Strike Price \$75.00 ± | 11.045 | 0,00 |
| 78 | 21.06.2024 | Simon Property Group Inc, Strike Price \$105.00 ± | 8.385 | 0,00 |
| 54 | 21.06.2024 | Simon Property Group Inc, Strike Price \$125.00 ± | 18.900 | 0,00 |
| 116 | 21.06.2024 | Simon Property Group Inc, Strike Price \$85.00 ± | 4.350 | 0,00 |
| 258.916 | 11.01.2024 | SK Hynix Inc, Strike Price KRW70,560.00 ∞ | 0 | 0,00 |
| 541 | 19.01.2024 | Skechers USA Inc, Strike Price \$35.00 ± | 0 | 0,00 |
| 52 | 19.01.2024 | Skyworks Solutions Inc, Strike Price \$100.00 ± | 910 | 0,00 |
| 77 | 19.01.2024 | Skyworks Solutions Inc, Strike Price \$110.00 ± | 10.780 | 0,00 |
| 45 | 19.01.2024 | Skyworks Solutions Inc, Strike Price \$115.00 ± | 17.100 | 0,00 |
| 63 | 19.01.2024 | Skyworks Solutions Inc, Strike Price \$82.50 ± | 189 | 0,00 |
| 107 | 19.01.2024 | Skyworks Solutions Inc, Strike Price \$92.50 ± | 2.407 | 0,00 |
| 2.520 | 19.01.2024 | Southern Co, Strike Price \$47.50 ± | 0 | 0,00 |
| 840 | 16.02.2024 | Southern Co, Strike Price \$47.50 ± | 0 | 0,00 |
| 736 | 19.01.2024 | Southern Co, Strike Price \$50.00 ± | 0 | 0,00 |
| 50 | 19.01.2024 | Southern Co, Strike Price \$52.50 ± | 0 | 0,00 |
| 10 | 21.06.2024 | Standard Chartered Plc, Strike Price GBP480.00 ± | 606 | 0,00 |
| 939 | 20.09.2024 | Standard Chartered Plc, Strike Price GBP480.00 ± | 101.748 | 0,01 |
| 153 | 15.03.2024 | Swiss Prime Site AG, Strike Price CHF56.00 ± | 182 | 0,00 |
| 267 | 20.09.2024 | Swiss Prime Site AG, Strike Price CHF64.00 ± | 13.958 | 0,00 |
| 54 | 19.01.2024 | T Rowe Price Group Inc, Strike Price \$110.00 ± | 18.360 | 0,00 |
| 40 | 17.01.2025 | T Rowe Price Group Inc, Strike Price \$110.00 ± | 49.200 | 0,00 |
| 83 | 17.01.2025 | T Rowe Price Group Inc, Strike Price \$75.00 ± | 18.468 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/ Nominalwert | Fällig- keit | Art | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|---------------------------------------|-----------------|--|------------------|------------------------------|
| Verkaufsoptionen (Fortsetzung) | | | | |
| 74 | 19.01.2024 | T Rowe Price Group Inc, Strike Price \$80.00 ± | 0 | 0,00 |
| 63 | 19.01.2024 | T Rowe Price Group Inc, Strike Price \$95.00 ± | 472 | 0,00 |
| 52 | 17.01.2025 | T Rowe Price Group Inc, Strike Price \$95.00 ± | 33.020 | 0,00 |
| 13 | 17.01.2024 | Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD17,800.00 ± | 3.749 | 0,00 |
| 79 | 19.01.2024 | Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price \$100.00 ± | 0 | 0,00 |
| 73 | 21.06.2024 | Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price \$100.00 ± | 10.476 | 0,00 |
| 55 | 19.01.2024 | Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price \$120.00 ± | 0 | 0,00 |
| 52 | 21.06.2024 | Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price \$120.00 ± | 7.722 | 0,00 |
| 36 | 21.06.2024 | Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price \$145.00 ± | 19.620 | 0,00 |
| 92 | 19.01.2024 | Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price \$75.00 ± | 0 | 0,00 |
| 385 | 19.01.2024 | Tanger Factory Outlet Centers Inc, Strike Price \$18.00 ± | 0 | 0,00 |
| 258 | 19.01.2024 | Tanger Factory Outlet Centers Inc, Strike Price \$22.00 ± | 258 | 0,00 |
| 163 | 19.01.2024 | Targa Resources Corp, Strike Price \$40.00 ± | 0 | 0,00 |
| 224 | 19.01.2024 | Targa Resources Corp, Strike Price \$50.00 ± | 0 | 0,00 |
| 237 | 19.01.2024 | Targa Resources Corp, Strike Price \$55.00 ± | 0 | 0,00 |
| 175 | 19.01.2024 | Targa Resources Corp, Strike Price \$60.00 ± | 0 | 0,00 |
| 158 | 19.01.2024 | Targa Resources Corp, Strike Price \$67.50 ± | 0 | 0,00 |
| 87 | 19.01.2024 | Targa Resources Corp, Strike Price \$70.00 ± | 0 | 0,00 |
| 67 | 21.06.2024 | TD SYNEX Corp, Strike Price \$100.00 ± | 26.800 | 0,00 |
| 133 | 21.06.2024 | TD SYNEX Corp, Strike Price \$70.00 ± | 4.988 | 0,00 |
| 91 | 21.06.2024 | TD SYNEX Corp, Strike Price \$85.00 ± | 11.148 | 0,00 |
| 116 | 19.01.2024 | Tenet Healthcare Corp, Strike Price \$50.00 ± | 348 | 0,00 |
| 98 | 19.01.2024 | Tenet Healthcare Corp, Strike Price \$60.00 ± | 4.900 | 0,00 |
| 84 | 19.01.2024 | Tenet Healthcare Corp, Strike Price \$70.00 ± | 4.830 | 0,00 |
| 35 | 21.06.2024 | Tesla Motors Inc, Strike Price \$150.00 ± | 10.850 | 0,00 |
| 24 | 21.06.2024 | Tesla Motors Inc, Strike Price \$183.33 ± | 18.300 | 0,00 |
| 17 | 21.06.2024 | Tesla Motors Inc, Strike Price \$216.67 ± | 27.625 | 0,00 |
| 375 | 15.03.2024 | Tetra Tech Inc, Strike Price \$120.00 ± | 0 | 0,00 |
| 46 | 19.01.2024 | Texas Instruments Inc, Strike Price \$125.00 ± | 230 | 0,00 |
| 37 | 19.01.2024 | Texas Instruments Inc, Strike Price \$155.00 ± | 851 | 0,00 |
| 57 | 21.06.2024 | Thor Industries Inc, Strike Price \$105.00 ± | 28.785 | 0,00 |
| 126 | 21.06.2024 | Thor Industries Inc, Strike Price \$70.00 ± | 8.820 | 0,00 |
| 88 | 21.06.2024 | Thor Industries Inc, Strike Price \$85.00 ± | 12.760 | 0,00 |
| 312.085 | 21.06.2024 | T-Mobile US Inc, Strike Price \$121.54 ∞ | 228.663 | 0,02 |
| 36 | 19.01.2024 | Tractor Supply Co, Strike Price \$160.00 ± | 0 | 0,00 |
| 29 | 19.01.2024 | Tractor Supply Co, Strike Price \$195.00 ± | 1.087 | 0,00 |
| 25 | 19.01.2024 | Tractor Supply Co, Strike Price \$230.00 ± | 37.000 | 0,00 |
| 5.027 | 15.03.2024 | Ubisoft Entertainment SA, Strike Price EUR18.00 ± | 372.056 | 0,02 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/ Nominalwert | Fällig- keit | Art | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|---------------------------------------|-----------------|--|------------------|------------------------------|
| Verkaufsoptionen (Fortsetzung) | | | | |
| 10.370 | 15.03.2024 | UBS Group AG, Strike Price CHF12.00 ± | 36.963 | 0,00 |
| 12 | 19.01.2024 | Ulta Beauty Inc, Strike Price \$360.00 ± | 96 | 0,00 |
| 16 | 19.01.2024 | Ulta Beauty Inc, Strike Price \$380.00 ± | 480 | 0,00 |
| 9 | 19.01.2024 | Ulta Beauty Inc, Strike Price \$440.00 ± | 495 | 0,00 |
| 13 | 19.01.2024 | Ulta Beauty Inc, Strike Price \$460.00 ± | 1.885 | 0,00 |
| 713 | 21.06.2024 | UniCredit SpA, Strike Price EUR10.00 ± | 40.208 | 0,00 |
| 2.405 | 21.06.2024 | UniCredit SpA, Strike Price EUR11.00 ± | 144.789 | 0,01 |
| 666.400 USD | 07.03.2024 | United States Dollar/Chinese Yuan Renminbi Currency Digital Down & In Option, Strike Price 6.00 ∞ | 167 | 0,00 |
| 439 | 19.01.2024 | United States Steel Corp, Strike Price \$13.00 ± | 439 | 0,00 |
| 306 | 19.01.2024 | United States Steel Corp, Strike Price \$15.00 ± | 306 | 0,00 |
| 213 | 19.01.2024 | United States Steel Corp, Strike Price \$18.00 ± | 213 | 0,00 |
| 143 | 19.01.2024 | United States Steel Corp, Strike Price \$22.00 ± | 143 | 0,00 |
| 68 | 21.06.2024 | Universal Display Corp, Strike Price \$120.00 ± | 11.390 | 0,00 |
| 47 | 21.06.2024 | Universal Display Corp, Strike Price \$145.00 ± | 16.685 | 0,00 |
| 35 | 21.06.2024 | Universal Display Corp, Strike Price \$170.00 ± | 29.750 | 0,00 |
| 92 | 19.01.2024 | Valero Energy Corp, Strike Price \$80.00 ± | 0 | 0,00 |
| 7.369 | 15.03.2024 | Virgin Galactic Holdings Inc, Strike Price \$1.00 ± | 29.476 | 0,00 |
| 10.827 | 19.01.2024 | Virgin Galactic Holdings Inc, Strike Price \$1.50 ± | 27.068 | 0,00 |
| 9.570 | 15.03.2024 | Virgin Galactic Holdings Inc, Strike Price \$1.50 ± | 110.055 | 0,01 |
| 2.667 | 19.01.2024 | Virgin Galactic Holdings Inc, Strike Price \$2.00 ± | 18.669 | 0,00 |
| 1.910 | 15.03.2024 | Virgin Galactic Holdings Inc, Strike Price \$2.00 ± | 47.750 | 0,00 |
| 3.371 | 16.02.2024 | Vishay Intertechnology Inc, Strike Price \$17.50 ± | 42.138 | 0,00 |
| 184 | 21.06.2024 | Voya Financial Inc, Strike Price \$50.00 ± | 5.060 | 0,00 |
| 129 | 21.06.2024 | Voya Financial Inc, Strike Price \$60.00 ± | 11.610 | 0,00 |
| 93 | 21.06.2024 | Voya Financial Inc, Strike Price \$70.00 ± | 27.203 | 0,00 |
| 47 | 19.01.2024 | Walmart Inc, Strike Price \$100.00 ± | 47 | 0,00 |
| 38 | 19.01.2024 | Walmart Inc, Strike Price \$125.00 ± | 76 | 0,00 |
| 32 | 19.01.2024 | Walmart Inc, Strike Price \$145.00 ± | 448 | 0,00 |
| 22 | 21.06.2024 | West Pharmaceutical Services Inc, Strike Price \$270.00 ± | 11.000 | 0,00 |
| 16 | 21.06.2024 | West Pharmaceutical Services Inc, Strike Price \$330.00 ± | 24.160 | 0,00 |
| 12 | 21.06.2024 | West Pharmaceutical Services Inc, Strike Price \$390.00 ± | 54.840 | 0,00 |
| 338 | 21.06.2024 | Western Digital Corp, Strike Price \$30.00 ± | 18.083 | 0,00 |
| 258 | 21.06.2024 | Western Digital Corp, Strike Price \$32.50 ± | 15.609 | 0,00 |
| 170 | 21.06.2024 | Western Digital Corp, Strike Price \$40.00 ± | 17.340 | 0,00 |
| 121 | 21.06.2024 | Western Digital Corp, Strike Price \$47.50 ± | 35.877 | 0,00 |
| 52 | 21.06.2024 | Wingstop Inc, Strike Price \$160.00 ± | 10.010 | 0,00 |
| 37 | 21.06.2024 | Wingstop Inc, Strike Price \$195.00 ± | 20.165 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/ Nominalwert | Fällig- keit | Art | Zeitwert US\$ | % des Nettöver- mögens |
|--|-----------------|--|--------------------|------------------------------|
| Verkaufsoptionen (Fortsetzung) | | | | |
| 28 | 21.06.2024 | Wingstop Inc, Strike Price \$230.00 ± | 35.840 | 0,00 |
| 141 | 19.01.2024 | Winnebago Industries Inc, Strike Price \$40.00 ± | 0 | 0,00 |
| 124 | 21.06.2024 | Winnebago Industries Inc, Strike Price \$40.00 ± | 14.880 | 0,00 |
| 113 | 19.01.2024 | Winnebago Industries Inc, Strike Price \$50.00 ± | 339 | 0,00 |
| 81 | 21.06.2024 | Winnebago Industries Inc, Strike Price \$50.00 ± | 5.468 | 0,00 |
| 94 | 19.01.2024 | Winnebago Industries Inc, Strike Price \$60.00 ± | 470 | 0,00 |
| 58 | 21.06.2024 | Winnebago Industries Inc, Strike Price \$60.00 ± | 11.600 | 0,00 |
| 310 | 15.03.2024 | Wolfspeed Inc, Strike Price \$30.00 ± | 34.100 | 0,00 |
| 50 | 19.01.2024 | Wyndham Worldwide Corp, Strike Price \$105.00 ± | 69.625 | 0,01 |
| 65 | 19.01.2024 | Wyndham Worldwide Corp, Strike Price \$77.50 ± | 1.235 | 0,00 |
| 55 | 19.01.2024 | Wyndham Worldwide Corp, Strike Price \$92.50 ± | 17.875 | 0,00 |
| 8.000 | 21.06.2024 | ZTO Express Cayman Inc, Strike Price \$13.00 ± | 120.000 | 0,01 |
| Beizulegender Zeitwert aus gekauften Optionskontrakten insgesamt ± (Prämie: (423.257.135) US\$) | | | 283.236.382 | 17,42 |

Die Gegenparteien von OTC-Optionskontrakten sind Bank of America Merrill Lynch, BNP Paribas, Daiwa, Goldman Sachs International, JPMorgan Chase Bank, Morgan Stanley, Nomura International, SMBC Nikko Capital Markets Ltd und UBS AG.

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettöver- mögens |
|-------------|-------------------------------|-----------------------------|-----------------------------------|------------------------------|
| 100 | 3D Systems Corp | Morgan Stanley | 19 | 0,00 |
| (170.361) | 3M Co | Goldman Sachs International | 3.818 | 0,00 |
| (730.949) | 3M Co | Morgan Stanley | 49.303 | 0,00 |
| (49.182) | 89bio Inc | JPMorgan Chase Bank | 26.482 | 0,00 |
| 9.024 | 8x8 Inc | Morgan Stanley | 2.140 | 0,00 |
| 100 | AAON Inc | Morgan Stanley | 155 | 0,00 |
| (45.116) | AbbVie Inc | Morgan Stanley | 2.461 | 0,00 |
| (642.442) | AbbVie Inc | Goldman Sachs International | 16.703 | 0,00 |
| (1.229.145) | AbbVie Inc | JPMorgan Chase Bank | 58.198 | 0,01 |
| (1.176) | ABM Industries Inc | Morgan Stanley | 1.493 | 0,00 |
| (2.591.887) | Academy Sports & Outdoors Inc | Morgan Stanley | 712.778 | 0,05 |
| 542 | Acadia Healthcare Co Inc | Morgan Stanley | 748 | 0,00 |
| (594.432) | Acadia Healthcare Co Inc | Goldman Sachs International | 27.401 | 0,00 |
| 12.208 | ACADIA Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 22.741 | 0,00 |
| 4.126 | Acadia Realty Trust | Morgan Stanley | 84 | 0,00 |
| (75.779) | Acuity Brands Inc | Morgan Stanley | 21.786 | 0,00 |
| (107.810) | Adidas AG | JPMorgan Chase Bank | 1.697 | 0,00 |
| (476) | Adient Plc | Morgan Stanley | 87 | 0,00 |
| 101 | ADMA Biologics Inc | Morgan Stanley | 37 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|-----------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (99.839) | Adobe Inc | JPMorgan Chase Bank | 2.009 | 0,00 |
| 1.125.088 | Adobe Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 37 | Advance Auto Parts Inc | Morgan Stanley | 23 | 0,00 |
| 298.938 | Advanced Energy Industries | Nomura | 0 | 0,00 |
| 1.806.846 | Advanced Micro Devices Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (93.615) | Advanced Micro Devices Inc | Morgan Stanley | 9.457 | 0,00 |
| (5.117) | Advantage Solutions Inc | Morgan Stanley | 1.688 | 0,00 |
| (72.271) | Adyen NV | Goldman Sachs International | 19.310 | 0,00 |
| (27.161) | Adyen NV | JPMorgan Chase Bank | 7.337 | 0,00 |
| (130.693) | AECOM | Morgan Stanley | 7.000 | 0,00 |
| (962) | Aehr Test Systems | Morgan Stanley | 1.648 | 0,00 |
| 1.036.081 | AeroVironment Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (2.205) | AerSale Corp | Morgan Stanley | 129 | 0,00 |
| (85.303) | AES Corp | Morgan Stanley | 46.063 | 0,00 |
| (82.921) | Affiliated Managers Group Inc | Morgan Stanley | 13.347 | 0,00 |
| 3.729 | Affirm Holdings Inc | Morgan Stanley | 4.793 | 0,00 |
| (86.878) | AGCO Corp | Morgan Stanley | 3.309 | 0,00 |
| (1.014) | Agilent Technologies Inc | Morgan Stanley | 574 | 0,00 |
| 1.942 | Agiliti Inc | Morgan Stanley | 444 | 0,00 |
| 55.103 | agilon health Inc | Morgan Stanley | 9.769 | 0,00 |
| 35.806 | Agios Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs International | 5.347 | 0,00 |
| (39.633) | AGNC Investment Corp | Morgan Stanley | 612 | 0,00 |
| 150.217 | AIB Group Plc | Goldman Sachs International | 13.647 | 0,00 |
| 309.036.600 | Aica Kogyo Co Ltd | Société Générale | 0 | 0,00 |
| (81.395) | Air Lease Corp | Morgan Stanley | 9.983 | 0,00 |
| 9 | Air Products & Chemicals Inc | Morgan Stanley | 0 | 0,00 |
| 427 | Air Transport Services Group Inc | Morgan Stanley | 135 | 0,00 |
| (86.030) | Airbnb Inc Class A | Morgan Stanley | 9.455 | 0,00 |
| 3.230 | Airbnb Inc Class A | Goldman Sachs International | 257 | 0,00 |
| (410.960) | Akamai Technologies Inc | Nomura | 0 | 0,00 |
| (179.545) | Akero Therapeutics Inc | JPMorgan Chase Bank | 93.706 | 0,01 |
| (32.443) | Alarm.com Holdings Inc | Goldman Sachs International | 4.265 | 0,00 |
| (73.748) | Alarm.com Holdings Inc | JPMorgan Chase Bank | 9.021 | 0,00 |
| (5.404) | Alarm.com Holdings Inc | Morgan Stanley | 322 | 0,00 |
| 580 | Albany International Corp Class A | Morgan Stanley | 1.074 | 0,00 |
| (5.222) | Albemarle Corp | Morgan Stanley | 3.124 | 0,00 |
| (1.219.407) | Albertsons Cos Inc Class A | Morgan Stanley | 44.471 | 0,00 |
| (74.973) | Alector Inc | Goldman Sachs International | 26.613 | 0,00 |
| (117.512) | Alector Inc | JPMorgan Chase Bank | 43.650 | 0,00 |
| (50.372) | Alector Inc | Morgan Stanley | 477 | 0,00 |
| 6.451 | Alexander & Baldwin Inc | Morgan Stanley | 229 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|--|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (2.005) | Alexandria Real Estate Equities Inc | Morgan Stanley | 3.085 | 0,00 |
| (379) | Algonquin Power & Utilities Corp | Morgan Stanley | 73 | 0,00 |
| 276.003 | Align Technology Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 204 | Alkami Technology Inc | Morgan Stanley | 76 | 0,00 |
| 8.645 | Alkermes Plc | Morgan Stanley | 3.107 | 0,00 |
| 111.511 | Allegion Plc | Goldman Sachs International | 903 | 0,00 |
| (18) | Allego NV | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 251 | ALLETE Inc | Morgan Stanley | 55 | 0,00 |
| 516 | Alliant Energy Corp | Morgan Stanley | 6 | 0,00 |
| (374.355) | Allianz SE | Goldman Sachs International | 8.607 | 0,00 |
| (89.761) | Allison Transmission Holdings Inc | Morgan Stanley | 1.606 | 0,00 |
| 4.436 | Allstate Corp | Morgan Stanley | 13.957 | 0,00 |
| 8.422 | Allurion Techno | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (110.198) | Ally Financial Inc | Morgan Stanley | 42.544 | 0,00 |
| (326.818) | Alphabet Inc Class C | Morgan Stanley | 48.474 | 0,01 |
| 1.994 | Alphatec Holdings Inc | Morgan Stanley | 426 | 0,00 |
| (847) | Alpine Immune Sciences Inc | Morgan Stanley | 268 | 0,00 |
| (2.266.155) | Amazon.com Inc | Morgan Stanley | 256.355 | 0,02 |
| (370.926) | Amazon.com Inc | JPMorgan Chase Bank | 33.593 | 0,00 |
| (398.050) | Amazon.com Inc | Goldman Sachs International | 40.732 | 0,00 |
| (23.631) | Ambrx Biopharma Inc | Goldman Sachs International | 9.654 | 0,00 |
| (13.925) | Ambrx Biopharma Inc | JPMorgan Chase Bank | 8.583 | 0,00 |
| (11.694) | Ambrx Biopharma Inc | Morgan Stanley | 2.804 | 0,00 |
| (9.047) | AMC Entertainment Holdings Inc Class A | Morgan Stanley | 2.280 | 0,00 |
| (80.823) | Amdocs Ltd | Morgan Stanley | 9.022 | 0,00 |
| 8.042.571 | American Airlines Group Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 29.460.000 | American Airlines Group Inc | Nomura | 1.346.434 | 0,09 |
| (2.563) | American Airlines Group Inc | Morgan Stanley | 1.340 | 0,00 |
| (3.001) | American Axle & Manufacturing Holdings Inc | Morgan Stanley | 270 | 0,00 |
| (301) | American Eagle Outfitters Inc | Morgan Stanley | 30 | 0,00 |
| 1.219 | American Express Co | Morgan Stanley | 3.923 | 0,00 |
| (106.049) | American International Group Inc | Morgan Stanley | 24.187 | 0,00 |
| 404 | American Software Inc Class A | Morgan Stanley | 167 | 0,00 |
| (8.642) | American Tower Corp | JPMorgan Chase Bank | 168 | 0,00 |
| (20.988) | American Tower Corp | Morgan Stanley | 715 | 0,00 |
| (64.949) | American Tower Corp | Goldman Sachs International | 9.614 | 0,00 |
| (141) | American Water Works Co Inc | Morgan Stanley | 101 | 0,00 |
| (118.527) | Ameriprise Financial Inc | Morgan Stanley | 20.504 | 0,00 |
| 1.139.142 | Ameriprise Financial Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 184.566 | AmerisourceBergen Corp | Goldman Sachs International | 90.347 | 0,01 |
| (159.380) | Amgen Inc | JPMorgan Chase Bank | 13.693 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------|--|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (40.171) | Amgen Inc | Morgan Stanley | 29.574 | 0,00 |
| (344.795) | Amgen Inc | Goldman Sachs International | 27.183 | 0,00 |
| 4.622 | Amicus Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 5.482 | 0,00 |
| (49) | Amkor Technology Inc | Morgan Stanley | 6 | 0,00 |
| 231 | Amphastar Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 531 | 0,00 |
| (1.483.329) | ams AG | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 13.500.000 | ams-OSRAM AG | Société Générale | 1.124.303 | 0,07 |
| 2.718 | Amylyx Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 2.150 | 0,00 |
| 7.003.784.700 | ANA Holdings Inc | Société Générale | 1.388.232 | 0,09 |
| (116.844) | Analog Devices Inc | Morgan Stanley | 10.188 | 0,00 |
| (34.573) | Analog Devices Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (2.996) | Anavex Life Sciences Corp | Morgan Stanley | 475 | 0,00 |
| 658 | AngioDynamics Inc | Morgan Stanley | 165 | 0,00 |
| (1.136.272) | Anheuser-Busch Inbev SA | Goldman Sachs International | 90.210 | 0,01 |
| (657.746) | Anheuser-Busch Inbev SA | JPMorgan Chase Bank | 27.592 | 0,00 |
| 253 | ANI Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 674 | 0,00 |
| (11.983) | Annaly Capital Management Inc | Morgan Stanley | 9.491 | 0,00 |
| (100) | Anterix Inc | Morgan Stanley | 109 | 0,00 |
| (9.103) | Antero Resources Corp | Morgan Stanley | 2.787 | 0,00 |
| 5.808 | Anywhere Real Estate Inc | Morgan Stanley | 2.562 | 0,00 |
| (110.912) | AO Smith Corp | Morgan Stanley | 27.999 | 0,00 |
| 214 | Aon Plc Class A | Morgan Stanley | 371 | 0,00 |
| 467.037 | APA Corp | JPMorgan Chase Bank | 10.005 | 0,00 |
| (3.368) | APA Corp | Morgan Stanley | 979 | 0,00 |
| (76.796) | Apartment Income REIT Corp | Morgan Stanley | 14.580 | 0,00 |
| 4.964 | Apartment Investment & Management Co Class A | Morgan Stanley | 198 | 0,00 |
| 17.194.831 | Apellis Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (17.822) | Apple Hospitality REIT Inc | Morgan Stanley | 6.001 | 0,00 |
| 2.504.446 | Apple Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (448.496) | Apple Inc | Morgan Stanley | 30.712 | 0,00 |
| (5.511) | Applied Digital Corp | Morgan Stanley | 546 | 0,00 |
| (161.024) | Applied Materials Inc | Morgan Stanley | 20.502 | 0,00 |
| 1.550.460 | Applied Materials Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (78.526) | AppLovin Corp Class A | Goldman Sachs International | 5.739 | 0,00 |
| (83.583) | AppLovin Corp Class A | Morgan Stanley | 1.771 | 0,00 |
| (3) | Arbor Realty Trust Inc | Morgan Stanley | 2 | 0,00 |
| 915 | Arcellx Inc | Morgan Stanley | 3.589 | 0,00 |
| 70.778 | Arch Capital Group Ltd | Morgan Stanley | 4.542 | 0,00 |
| 3.607 | Archer-Daniels-Midland Co | Morgan Stanley | 2.606 | 0,00 |
| 8.922 | Archrock Inc | Morgan Stanley | 411 | 0,00 |
| (348) | Arcturus Therapeutics Holdings Inc | Morgan Stanley | 15 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|--------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 7.238 | Ares Capital Corp | Morgan Stanley | 2.017 | 0,00 |
| (293.332) | Argenx SE | Morgan Stanley | 9.833 | 0,00 |
| 213 | Arhaus Inc | Morgan Stanley | 148 | 0,00 |
| (71.566) | Armstrong World Industries Inc | Morgan Stanley | 27.598 | 0,00 |
| 22.867 | Arqit Quantum Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (145) | Array Technologies Inc | Morgan Stanley | 14 | 0,00 |
| (1.178) | Arrow Electronics Inc | Morgan Stanley | 1.877 | 0,00 |
| 52.104 | Arrowhead Pharmaceuticals Inc | JPMorgan Chase Bank | 215 | 0,00 |
| (121) | Artivion Inc | Morgan Stanley | 23 | 0,00 |
| 562 | ASGN Inc | Morgan Stanley | 782 | 0,00 |
| (135) | Ashland Inc | Morgan Stanley | 151 | 0,00 |
| (145.180) | ASR Nederland NV | Goldman Sachs International | 33.279 | 0,00 |
| (7.306) | Associated Banc-Corp | Morgan Stanley | 925 | 0,00 |
| 5.214.873 | Astellas Pharma Inc | Goldman Sachs International | 5.915 | 0,00 |
| (208.757) | AstraZeneca Plc | Morgan Stanley | 1.450 | 0,00 |
| 3.790 | Astronics Corp | Morgan Stanley | 2.147 | 0,00 |
| (158.083) | AT&T Inc | Morgan Stanley | 9.827 | 0,00 |
| (214.628) | ATI Inc | JPMorgan Chase Bank | 28.712 | 0,00 |
| (212.978) | ATI Inc | Goldman Sachs International | 25.159 | 0,00 |
| (37.967) | ATI Inc | Morgan Stanley | 5.436 | 0,00 |
| 537 | Atlantic Union Bankshares Corp | Morgan Stanley | 56 | 0,00 |
| (18.872) | Atlassian Corp Class A | Goldman Sachs International | 5.525 | 0,00 |
| (24.304) | Atlassian Corp Class A | Morgan Stanley | 5.731 | 0,00 |
| (12.149) | Atlassian Corp Class A | JPMorgan Chase Bank | 1.826 | 0,00 |
| (5.356) | Aurinia Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 665 | 0,00 |
| (122.807) | Autodesk Inc | Morgan Stanley | 20.983 | 0,00 |
| 1.650.076 | Autodesk Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (108) | Autoliv Inc | Morgan Stanley | 80 | 0,00 |
| 34.531 | Automatic Data Processing Inc | Goldman Sachs International | 664 | 0,00 |
| 166.732 | Automatic Data Processing Inc | JPMorgan Chase Bank | 178 | 0,00 |
| 1.126.803 | AutoZone Inc | JPMorgan Chase Bank | 20.590 | 0,00 |
| (10) | AvalonBay Communities Inc | Morgan Stanley | 23 | 0,00 |
| (15.500) | Avantor Inc | Morgan Stanley | 2.210 | 0,00 |
| (9.873) | AvePoint Inc | Morgan Stanley | 1.707 | 0,00 |
| (197.990) | Avidity Biosciences Inc | JPMorgan Chase Bank | 40.395 | 0,00 |
| (5.554) | Avidity Biosciences Inc | Goldman Sachs International | 1.602 | 0,00 |
| 11.106 | AvidXchange Holdings Inc | Morgan Stanley | 1.439 | 0,00 |
| (51) | Avis Budget Group Inc | Morgan Stanley | 212 | 0,00 |
| (53.389) | Aviva Plc | Goldman Sachs International | 614 | 0,00 |
| (87.008) | Avnet Inc | Morgan Stanley | 4.086 | 0,00 |
| (509.153) | AXA SA | Goldman Sachs International | 28.504 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|--------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 6.407 | Axalta Coating Systems Ltd | Morgan Stanley | 574 | 0,00 |
| 1.189.894 | Axon Enterprise Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (61) | Axos Financial Inc | Morgan Stanley | 134 | 0,00 |
| 2.872 | B Riley Financial Inc | Morgan Stanley | 1.714 | 0,00 |
| (10) | B2Gold Corp | Morgan Stanley | 1 | 0,00 |
| 310 | Badger Meter Inc | Morgan Stanley | 491 | 0,00 |
| (233.645) | Baker Hughes Co | Morgan Stanley | 3.360 | 0,00 |
| (614.940) | Baker Hughes Co | JPMorgan Chase Bank | 24.438 | 0,00 |
| (674) | Ball Corp | Morgan Stanley | 249 | 0,00 |
| (93.084) | Banca Mediolanum SpA | Goldman Sachs International | 4.335 | 0,00 |
| 6.000.000 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. | Société Générale | 481.665 | 0,03 |
| 204.927 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. | Goldman Sachs International | 12.250 | 0,00 |
| 205.818 | Banco BPM SpA | Goldman Sachs International | 3.277 | 0,00 |
| 4.300.000 | Banco BPM SpA | Société Générale | 365.366 | 0,02 |
| (1.310.473) | Banco Bradesco SA | Goldman Sachs International | 12.088 | 0,00 |
| 38.495 | Banco De Sabadell SA | Goldman Sachs International | 21.094 | 0,00 |
| 9.000.000 | Banco Santander S.A. | Société Générale | 654.228 | 0,04 |
| 24 | Bank of Montreal | Morgan Stanley | 4 | 0,00 |
| (97.514) | Bank Pekao SA | Morgan Stanley | 1.361 | 0,00 |
| (1.838.020) | Bank Pekao SA | Goldman Sachs International | 139.889 | 0,01 |
| (1.515.056) | Bank Polska Kasa Opieki SA | JPMorgan Chase Bank | 145.195 | 0,01 |
| (43.686) | Barclays Plc | Goldman Sachs International | 10.516 | 0,00 |
| 2.573 | Barnes Group Inc | Morgan Stanley | 4.054 | 0,00 |
| 443.017 | Bath & Body Works Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (607.906) | Bath & Body Works Inc | JPMorgan Chase Bank | 127.280 | 0,01 |
| (127.281) | Bath & Body Works Inc | Morgan Stanley | 40.896 | 0,00 |
| 650 | Bausch + Lomb Corp | Morgan Stanley | 789 | 0,00 |
| (130.636) | Baxter International Inc | Morgan Stanley | 8.021 | 0,00 |
| (6.979) | Baxter International Inc | JPMorgan Chase Bank | 364 | 0,00 |
| 351 | BCE Inc | Morgan Stanley | 12 | 0,00 |
| 66.746 | Beam Therapeutics Inc | Goldman Sachs International | 304 | 0,00 |
| 17.068 | Beam Therapeutics Inc | JPMorgan Chase Bank | 208 | 0,00 |
| (1.217) | Beam Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 1.503 | 0,00 |
| 18.494 | Beauty Health Co | JPMorgan Chase Bank | 5.528 | 0,00 |
| 9.129 | Beauty Health Co | Goldman Sachs International | 2.852 | 0,00 |
| 80.601 | Becton Dickinson & Co | Morgan Stanley | 3.866 | 0,00 |
| (1.395.736) | BellRing Brands Inc | Goldman Sachs International | 849.338 | 0,05 |
| (311.038) | BellRing Brands Inc | JPMorgan Chase Bank | 72.041 | 0,01 |
| (490) | Benchmark Electronics Inc | Morgan Stanley | 196 | 0,00 |
| 160.047 | Berkshire Hathaway Inc Class B | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 74.611 | Berkshire Hathaway Inc Class B | Morgan Stanley | 634 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|----------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (1.586) | Berry Global Group Inc | Morgan Stanley | 225 | 0,00 |
| 84.853 | Best Buy Co Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 456.694 | Bidvest Group Ltd | Goldman Sachs International | 335 | 0,00 |
| (141) | BILL Holdings Inc | Morgan Stanley | 313 | 0,00 |
| (69.155) | Bill.com Holdings Inc | JPMorgan Chase Bank | 11.274 | 0,00 |
| 13.066 | BioCryst Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs International | 3.610 | 0,00 |
| 100 | BioCryst Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 21 | 0,00 |
| (513.377) | Biogen Inc | JPMorgan Chase Bank | 22.011 | 0,00 |
| (197.927) | Biohaven Ltd | Morgan Stanley | 139.566 | 0,01 |
| (43.675) | Biohaven Ltd | Goldman Sachs International | 35.954 | 0,00 |
| 244 | Bio-Techne Corp | Morgan Stanley | 88 | 0,00 |
| 220 | BJ's Restaurants Inc | Morgan Stanley | 671 | 0,00 |
| 45.741 | BJ's Wholesale Club Holdings Inc | Morgan Stanley | 2.602 | 0,00 |
| 412.697 | BlackRock Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (3.258) | Block Inc | Morgan Stanley | 1.084 | 0,00 |
| (5.695) | Block Inc | JPMorgan Chase Bank | 31 | 0,00 |
| (36.877) | Block Inc Class A | Goldman Sachs International | 17.332 | 0,00 |
| 4.150 | Bloomin' Brands Inc | Morgan Stanley | 4.697 | 0,00 |
| 2.025 | Blue Bird Corp | Morgan Stanley | 1.689 | 0,00 |
| (2.966) | Blueprint Medicines Corp | Goldman Sachs International | 502 | 0,00 |
| (189.465) | Blueprint Medicines Corp | JPMorgan Chase Bank | 142.922 | 0,01 |
| 9.200.000 | BNP Paribas S.A. | Société Générale | 677.195 | 0,04 |
| (73.369) | Booking Holdings Inc | Goldman Sachs International | 8.195 | 0,00 |
| (230.299) | Booking Holdings Inc | JPMorgan Chase Bank | 28.575 | 0,00 |
| (191.216) | Booking Holdings Inc | Morgan Stanley | 41.699 | 0,00 |
| 2.116 | Booz Allen Hamilton Holding Corp | Morgan Stanley | 4.804 | 0,00 |
| (170) | Borr Drilling Ltd | Morgan Stanley | 21 | 0,00 |
| 46.900 | Boston Beer Co Inc Class A | Morgan Stanley | 4.171 | 0,00 |
| (455) | Boston Omaha Corp Class A | Morgan Stanley | 141 | 0,00 |
| (128.498) | Boston Properties Inc | Morgan Stanley | 34.341 | 0,00 |
| (778.269) | Boston Scientific Corp | Goldman Sachs International | 50.192 | 0,00 |
| (33.293) | Boston Scientific Corp | JPMorgan Chase Bank | 168 | 0,00 |
| (477.724) | Boyd Gaming Corp | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (203) | Braze Inc Class A | Morgan Stanley | 55 | 0,00 |
| 94.469 | Braze Inc Class A | Goldman Sachs International | 1.261 | 0,00 |
| (247) | Bread Financial Holdings Inc | Morgan Stanley | 24 | 0,00 |
| (2.570.585) | Bridgebio Pharma Inc | Nomura | 0 | 0,00 |
| (77.187) | Brighthouse Financial Inc | Morgan Stanley | 8.636 | 0,00 |
| 1.203 | Brinker International Inc | Morgan Stanley | 1.780 | 0,00 |
| 298.766 | Bristol-Myers Squibb Co | Goldman Sachs International | 56.121 | 0,01 |
| 9.306 | Bristol-Myers Squibb Co | JPMorgan Chase Bank | 804 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------|---|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (218.637) | Broadcom Inc | Morgan Stanley | 52.337 | 0,00 |
| 1.222.314 | Broadcom Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (3.051) | Broadstone Net Lease Inc | Morgan Stanley | 603 | 0,00 |
| (705) | Brookfield Asset Management Ltd Class A | Morgan Stanley | 55 | 0,00 |
| 4.026 | Brown & Brown Inc | Morgan Stanley | 3.600 | 0,00 |
| (1.189) | Brown-Forman Corp Class B | Morgan Stanley | 351 | 0,00 |
| (111.618) | Builders FirstSource Inc | Morgan Stanley | 44.126 | 0,00 |
| (1.117) | Bunge Global S.A. | Morgan Stanley | 1.849 | 0,00 |
| 216.599 | Bunge Global SA | Goldman Sachs International | 2.207 | 0,00 |
| 335.383 | Bunge Global SA | JPMorgan Chase Bank | 13.644 | 0,00 |
| 419.030 | Burberry Group Plc | JPMorgan Chase Bank | 118.343 | 0,01 |
| 54.040 | Burberry Group Plc | Goldman Sachs International | 13.998 | 0,00 |
| 443.283 | Bureau Veritas SA | Société Générale | 0 | 0,00 |
| (1.818.349) | Burlington Stores Inc | JPMorgan Chase Bank | 153.406 | 0,01 |
| 813 | Burlington Stores Inc | Morgan Stanley | 2.750 | 0,00 |
| (690) | BWX Technologies Inc | Morgan Stanley | 106 | 0,00 |
| (73.655) | Cabaletta Bio Inc | Morgan Stanley | 39.120 | 0,00 |
| (31.032) | Cabaletta Bio Inc | Goldman Sachs International | 21.439 | 0,00 |
| 3.568 | Cactus Inc Class A | Morgan Stanley | 841 | 0,00 |
| (5.638) | Cadence Bank | Morgan Stanley | 2.166 | 0,00 |
| (108.848) | Cadence Design Systems Inc | Morgan Stanley | 17.068 | 0,00 |
| 2.541 | Cadre Holdings Inc | Morgan Stanley | 2.176 | 0,00 |
| 100 | CAE Inc | Morgan Stanley | 38 | 0,00 |
| 354.458 | CaixaBank SA | Goldman Sachs International | 43.241 | 0,00 |
| (100) | Caleres Inc | Morgan Stanley | 4 | 0,00 |
| (2.879) | California Resources Corp | Morgan Stanley | 445 | 0,00 |
| 2.230 | Calix Inc | Morgan Stanley | 2.730 | 0,00 |
| (5.625) | Callon Petroleum Co | Morgan Stanley | 8.990 | 0,00 |
| (666) | Camden Property Trust | Morgan Stanley | 250 | 0,00 |
| (2.159) | Cameco Corp | Morgan Stanley | 97 | 0,00 |
| 943.322 | Campbell Soup Co | Goldman Sachs International | 3.408 | 0,00 |
| (677) | Camping World Holdings Inc Class A | Morgan Stanley | 194 | 0,00 |
| (501) | Canadian Imperial Bank of Commerce | Morgan Stanley | 197 | 0,00 |
| (397.956) | Canadian Natural Resources | JPMorgan Chase Bank | 17.424 | 0,00 |
| (1.379) | Canadian Pacific Kansas City Ltd | Morgan Stanley | 810 | 0,00 |
| (2.001) | Cannae Holdings Inc | Morgan Stanley | 517 | 0,00 |
| 231 | Capital One Financial Corp | Morgan Stanley | 41 | 0,00 |
| (13.488.238) | Capitec Bank Holdings Ltd | Goldman Sachs International | 115.882 | 0,01 |
| (4.492.939) | Capitec Bank Holdings Ltd | JPMorgan Chase Bank | 20.230 | 0,00 |
| 1.641.810 | Cardinal Health Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (9.374) | Cargurus Inc | Morgan Stanley | 477 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|------------|--|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (47.182) | Cargurus Inc | Goldman Sachs International | 5.484 | 0,00 |
| (3.490) | Carlyle Group Inc | Morgan Stanley | 141 | 0,00 |
| (112.853) | Carmax Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 17.599.162 | Carnival Corp | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (889) | Carnival Corp | Morgan Stanley | 308 | 0,00 |
| 15.400.000 | Carnival Corp | Nomura | 8.309.590 | 0,51 |
| (83.861) | Carter's Inc | Morgan Stanley | 10.201 | 0,00 |
| (1.360) | Carvana Co | Morgan Stanley | 6.386 | 0,00 |
| (453.297) | Casey's General Stores Inc | JPMorgan Chase Bank | 1.659 | 0,00 |
| (646.724) | Casey's General Stores Inc | Goldman Sachs International | 4.777 | 0,00 |
| 320 | CATCHA INVT Corp | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 44 | Caterpillar Inc | Morgan Stanley | 13 | 0,00 |
| (334) | CBRE Group Inc Class A | Morgan Stanley | 75 | 0,00 |
| 42.196 | CCC Intelligent Solutions Holdings Inc | Morgan Stanley | 3.836 | 0,00 |
| (119.986) | CDW Corp | Morgan Stanley | 16.258 | 0,00 |
| 913 | CDW Corp | JPMorgan Chase Bank | 7 | 0,00 |
| 630.754 | CDW Corp | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 7.743.705 | Cellnex Telecom SA | Société Générale | 864.721 | 0,06 |
| 36.553 | Celsius Holdings Inc | Morgan Stanley | 2.509 | 0,00 |
| (73.887) | Celsius Holdings Inc | Goldman Sachs International | 4.573 | 0,00 |
| (445.526) | Celsius Holdings Inc | JPMorgan Chase Bank | 21.489 | 0,00 |
| (2.847) | Cenovus Energy Inc | Morgan Stanley | 400 | 0,00 |
| 980.922 | Centene Corp | Goldman Sachs International | 12.427 | 0,00 |
| (126.357) | Centene Corp | Morgan Stanley | 8.569 | 0,00 |
| 1.479 | Cerevel Therapeutics Holdings Inc | Morgan Stanley | 1.505 | 0,00 |
| 8.780.472 | Ceridian HCM Holding Inc | Nomura | 0 | 0,00 |
| 71.888 | Ceridian HCM Holding Inc | Morgan Stanley | 479 | 0,00 |
| (119.991) | CF Industries Holdings Inc | Morgan Stanley | 7.572 | 0,00 |
| 440.090 | ChampionX Corp | JPMorgan Chase Bank | 29.719 | 0,00 |
| 666.428 | ChampionX Corp | Goldman Sachs International | 44.736 | 0,00 |
| (499.812) | Charles River Laboratories International Inc | Goldman Sachs International | 45.610 | 0,01 |
| 285.574 | Charles Schwab Corp | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 45.582 | Charter Communications Inc Class A | Morgan Stanley | 4.100 | 0,00 |
| 10.168 | Chegg Inc | Morgan Stanley | 2.833 | 0,00 |
| (82.487) | Chemours Co | Morgan Stanley | 14.508 | 0,00 |
| 396.623 | Chemours Co | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 71.479 | Cheniere Energy Inc | Morgan Stanley | 9.354 | 0,00 |
| 422.993 | Chesapeake Energy Corp | JPMorgan Chase Bank | 3.501 | 0,00 |
| 446 | Chevron Corp | Goldman Sachs International | 2 | 0,00 |
| 677.109 | Chevron Corp | JPMorgan Chase Bank | 5.055 | 0,00 |
| (449) | Chevron Corp | Morgan Stanley | 1.136 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|---|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (43.918) | Chewy Inc Class A | Goldman Sachs International | 6.774 | 0,00 |
| (378.709) | Chewy Inc Class A | Morgan Stanley | 94.711 | 0,01 |
| (96.100) | Chewy Inc Class A | JPMorgan Chase Bank | 19.313 | 0,00 |
| 1.393 | Children's Place Inc | Morgan Stanley | 36 | 0,00 |
| 2.279.102 | Chipotle Mexican Grill Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 120.678 | Choice Hotels International Inc | JPMorgan Chase Bank | 181 | 0,00 |
| 654.232 | Choice Hotels International Inc | Morgan Stanley | 47.394 | 0,00 |
| (586.754) | Chord Energy Corp | JPMorgan Chase Bank | 29.554 | 0,00 |
| (921.735) | Church & Dwight Co Inc | JPMorgan Chase Bank | 27.712 | 0,00 |
| (171.082) | Church & Dwight Co Inc | Morgan Stanley | 4.998 | 0,00 |
| (666.297) | Church & Dwight Co Inc | Goldman Sachs International | 15.194 | 0,00 |
| 19.030 | Cie Financiere Richemont SA Class A | JPMorgan Chase Bank | 251 | 0,00 |
| (527.281) | Cigna Group | Goldman Sachs International | 6.944 | 0,00 |
| 4.242 | Cincinnati Financial Corp | Morgan Stanley | 6.635 | 0,00 |
| 27 | Cintas Corp | Morgan Stanley | 1.196 | 0,00 |
| (56.171) | Cirrus Logic Inc | Morgan Stanley | 4.650 | 0,00 |
| 71.122 | Cisco Systems Inc | Morgan Stanley | 2.091 | 0,00 |
| (125.707) | Citigroup Inc | Morgan Stanley | 15.828 | 0,00 |
| 4.433 | Citizens Financial Group Inc | Morgan Stanley | 273 | 0,00 |
| (5.326) | Civitas Resources Inc | Morgan Stanley | 7.265 | 0,00 |
| (1.196) | Claros Mortgage Trust Inc | Morgan Stanley | 671 | 0,00 |
| 3.531 | Clearwater Analytics Holdings Inc Class A | Morgan Stanley | 208 | 0,00 |
| 2.949 | Clearway Energy Inc Class C | Morgan Stanley | 1.855 | 0,00 |
| (120.591) | Cleveland-Cliffs Inc | Morgan Stanley | 31.190 | 0,00 |
| 1.677.111 | Cleveland-Cliffs Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 523.365 | Clorox Co | JPMorgan Chase Bank | 49 | 0,00 |
| 1.640 | Clorox Co | Morgan Stanley | 1.769 | 0,00 |
| (17.637) | Cloudflare Inc Class A | Morgan Stanley | 1.365 | 0,00 |
| (28.479) | Cloudflare Inc Class A | Goldman Sachs International | 11.170 | 0,00 |
| 73.273 | CME Group Inc | Morgan Stanley | 332 | 0,00 |
| (83) | CME Group Inc Class A | Morgan Stanley | 209 | 0,00 |
| 3.267 | CMS Energy Corp | Morgan Stanley | 1.912 | 0,00 |
| (78.543) | CNA Financial Corp | Morgan Stanley | 6.928 | 0,00 |
| (1.338) | CNO Financial Group Inc | Morgan Stanley | 267 | 0,00 |
| (3.565) | CNX Resources Corp | Morgan Stanley | 317 | 0,00 |
| 229 | Coca-Cola Co | Morgan Stanley | 26 | 0,00 |
| 1.296 | Cognex Corp | Morgan Stanley | 103 | 0,00 |
| 2.009 | Coinbase Global Inc Class A | Morgan Stanley | 18.359 | 0,00 |
| 422 | Collegium Pharmaceutical Inc | Morgan Stanley | 243 | 0,00 |
| (70.977) | Columbia Banking System Inc | Morgan Stanley | 27.269 | 0,00 |
| (1.692) | Columbia Sportswear Co | Morgan Stanley | 4.218 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|--------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (304.392) | Comcast Corp Class A | Morgan Stanley | 17.454 | 0,00 |
| 60.148 | Comcast Corp Class A | Goldman Sachs International | 1.143 | 0,00 |
| (84.057) | Comerica Inc | Morgan Stanley | 20.137 | 0,00 |
| (212.932) | Commercial Metals Co | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 2.141 | CommVault Systems Inc | Morgan Stanley | 455 | 0,00 |
| (9.229) | Compass Inc Class A | Morgan Stanley | 13.232 | 0,00 |
| 67.947 | Comstock Resources Inc | JPMorgan Chase Bank | 12.518 | 0,00 |
| (71.265) | Concentrix Corp | Morgan Stanley | 17.196 | 0,00 |
| 3.573.562 | Confluent Inc Class A | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (922.552) | CONMED Corp | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (3.476) | ConocoPhillips | Morgan Stanley | 6.030 | 0,00 |
| (817.107) | ConocoPhillips | JPMorgan Chase Bank | 10.937 | 0,00 |
| (1.082.336) | Constellation Brands Inc Class A | Goldman Sachs International | 70.375 | 0,01 |
| 214 | Constellation Brands Inc Class A | Morgan Stanley | 1.055 | 0,00 |
| 32.700 | Constellation Energy Corp | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (267.937) | Cooper Cos Inc | JPMorgan Chase Bank | 17.030 | 0,00 |
| 4.134 | Copart Inc | Goldman Sachs International | 6 | 0,00 |
| 1.821 | COPT Defense Properties | Morgan Stanley | 72 | 0,00 |
| 3.625 | Corcept Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 4.400 | 0,00 |
| 1.659 | Core & Main Inc Class A | Morgan Stanley | 230 | 0,00 |
| (77.373) | Corebridge Financial Inc | Morgan Stanley | 7.044 | 0,00 |
| (195.837) | Corp ACCIONA Energias Renovables SA | Goldman Sachs International | 23.489 | 0,00 |
| (1.023) | Corsair Gaming Inc | Morgan Stanley | 349 | 0,00 |
| 80.201 | Corteva Inc | Morgan Stanley | 2.893 | 0,00 |
| (789) | Costco Wholesale Corp | Morgan Stanley | 2.900 | 0,00 |
| (264.694) | Coterra Energy Inc | Goldman Sachs International | 809 | 0,00 |
| 364.141 | Coterra Energy Inc | JPMorgan Chase Bank | 20.640 | 0,00 |
| (23.329) | Coty Inc Class A | JPMorgan Chase Bank | 3.851 | 0,00 |
| (38.226) | Coty Inc Class A | Goldman Sachs International | 11.371 | 0,00 |
| (27.707) | Coupang Inc | Goldman Sachs International | 365 | 0,00 |
| (15.496) | Coupang Inc | Morgan Stanley | 58 | 0,00 |
| 3.444 | Cousins Properties Inc | Morgan Stanley | 575 | 0,00 |
| (241.882) | CPFL Energia SA | Goldman Sachs International | 8.137 | 0,00 |
| 16 | Cracker Barrel Old Country Store Inc | Morgan Stanley | 1 | 0,00 |
| 100 | Crane Co | Morgan Stanley | 537 | 0,00 |
| 9.100.000 | Credit Agricole S.A. | Société Générale | 384.371 | 0,03 |
| 6.020 | Credo Technology Group Holding Ltd | Morgan Stanley | 308 | 0,00 |
| (536.591) | CRH Plc | JPMorgan Chase Bank | 48.494 | 0,01 |
| 148.810 | CRISPR Therapeutics AG | Goldman Sachs International | 9.102 | 0,00 |
| (1.099.363) | Crocs Inc | Morgan Stanley | 86.165 | 0,01 |
| 1.838 | Crown Castle Inc | JPMorgan Chase Bank | 11 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|-----------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 65.008 | Crown Castle Inc | Goldman Sachs International | 834 | 0,00 |
| (23) | Crown Holdings Inc | Morgan Stanley | 19 | 0,00 |
| (583) | CryoPort Inc | Morgan Stanley | 253 | 0,00 |
| 223 | CS Disco Inc | Morgan Stanley | 28 | 0,00 |
| 189 | CSG Systems International Inc | Morgan Stanley | 42 | 0,00 |
| (765) | CubeSmart | Morgan Stanley | 221 | 0,00 |
| 1.265 | Curtiss-Wright Corp | Morgan Stanley | 4.909 | 0,00 |
| 2.461 | Cushman & Wakefield Plc | Morgan Stanley | 283 | 0,00 |
| (926) | Custom Truck One Source Inc | Morgan Stanley | 113 | 0,00 |
| 429.611 | CVR Energy Inc | Goldman Sachs International | 28.494 | 0,00 |
| 408.226 | CVR Energy Inc | JPMorgan Chase Bank | 39.105 | 0,00 |
| (34.926) | CVS Health Corp | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (259) | CVS Health Corp | Morgan Stanley | 9 | 0,00 |
| 236.899.016 | CyberAgent Inc | Nomura | 0 | 0,00 |
| (107.428) | CyberArk Software Ltd | JPMorgan Chase Bank | 11.627 | 0,00 |
| (82) | CyberArk Software Ltd | Morgan Stanley | 67 | 0,00 |
| (210.122) | Cymabay Therapeutics Inc | Goldman Sachs International | 45.032 | 0,00 |
| (284.751) | Cymabay Therapeutics Inc | JPMorgan Chase Bank | 59.684 | 0,00 |
| (8.272) | Cytek Biosciences Inc | Morgan Stanley | 2.155 | 0,00 |
| (3.275) | Cytokinetics Inc | Goldman Sachs International | 4.892 | 0,00 |
| 367.843.500 | Daifuku Co Ltd | Société Générale | 0 | 0,00 |
| (1.436) | Dana Inc | Morgan Stanley | 162 | 0,00 |
| (1.787.516) | Danske Bank A/S | Goldman Sachs International | 23.212 | 0,00 |
| 360 | Darling Ingredients Inc | Morgan Stanley | 20 | 0,00 |
| (151) | Datadog Inc Class A | Morgan Stanley | 217 | 0,00 |
| 910.764 | Dave & Buster's Entertainment Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (19) | Dave & Buster's Entertainment Inc | Morgan Stanley | 1 | 0,00 |
| 390.080 | Davide Campari-Milano NV | Société Générale | 0 | 0,00 |
| 144 | DaVita Inc | Morgan Stanley | 9 | 0,00 |
| (1.670.931) | Deere & Co | JPMorgan Chase Bank | 64.952 | 0,01 |
| (641.764) | Deere & Co | Goldman Sachs International | 2.810 | 0,00 |
| (213.863) | Deere & Co | Morgan Stanley | 3.475 | 0,00 |
| 179.645 | Delek US Holdings Inc | JPMorgan Chase Bank | 6.690 | 0,00 |
| 279.776 | Delek US Holdings Inc | Goldman Sachs International | 13.672 | 0,00 |
| (2.638) | Delek US Holdings Inc | Morgan Stanley | 2.278 | 0,00 |
| (187.935) | Dell Technologies Inc Class C | Morgan Stanley | 30.789 | 0,00 |
| (613.768) | Delta Air Lines Inc | JPMorgan Chase Bank | 44.393 | 0,00 |
| 70.194 | Denali Therapeutics Inc | Goldman Sachs International | 1.550 | 0,00 |
| 4.136 | Denny's Corp | Morgan Stanley | 1.425 | 0,00 |
| (527) | DENTSPLY SIRONA Inc | Morgan Stanley | 6 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|-----------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (181.654) | Deutsche Bank AG | Goldman Sachs International | 26.964 | 0,00 |
| 10.000.000 | Deutsche Lufthansa AG | Société Générale | 1.124.413 | 0,07 |
| 2.208.921 | Deutsche Lufthansa AG | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 38.396.775 | Deutsche Telekom AG | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (869.609) | Devon Energy Corp | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (641.178) | Devon Energy Corp | JPMorgan Chase Bank | 9.190 | 0,00 |
| (71.291) | Dexcom Inc | JPMorgan Chase Bank | 31.242 | 0,00 |
| (102.598) | Dexcom Inc | Morgan Stanley | 34.155 | 0,00 |
| 608.085 | Dexcom Inc | Goldman Sachs International | 4.944 | 0,00 |
| 674.044 | Diageo Plc | JPMorgan Chase Bank | 17.824 | 0,00 |
| 754.923 | Diamondback Energy Inc | JPMorgan Chase Bank | 10.254 | 0,00 |
| (379) | Diamondback Energy Inc | Morgan Stanley | 1.508 | 0,00 |
| 3.161.715 | Dick's Sporting Goods Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 1.652 | DigitalBridge Group Inc | Morgan Stanley | 523 | 0,00 |
| (1.146) | Discount Medicine Inc | Morgan Stanley | 418 | 0,00 |
| (3.227.805) | Discovery Ltd | JPMorgan Chase Bank | 6.072 | 0,00 |
| (478.259) | DISH Network Corp Class A | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (118.258) | DocuSign Inc | Morgan Stanley | 52.767 | 0,01 |
| (610.479) | Dollar General Corp | JPMorgan Chase Bank | 22.976 | 0,00 |
| 522 | Dollar General Corp | Morgan Stanley | 2.561 | 0,00 |
| 72.641 | Dollar Tree Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (902.212) | Dollar Tree Inc | JPMorgan Chase Bank | 43.246 | 0,00 |
| (7.926) | Dominion Energy Inc | Morgan Stanley | 4.315 | 0,00 |
| 1.052.749 | Domino's Pizza Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (10.822) | Domino's Pizza Inc | Morgan Stanley | 692 | 0,00 |
| 3.781 | Domo Inc Class B | Morgan Stanley | 1.094 | 0,00 |
| (83.604) | Donaldson Co Inc | Morgan Stanley | 8.159 | 0,00 |
| 898 | Donnelley Financial Solutions Inc | Morgan Stanley | 572 | 0,00 |
| (1.880) | DoorDash Inc Class A | Morgan Stanley | 2.688 | 0,00 |
| (569) | Dorian LPG Ltd | Morgan Stanley | 697 | 0,00 |
| (92.200) | DoubleVerify Holdings Inc | Morgan Stanley | 11.992 | 0,00 |
| (3.942) | Douglas Emmett Inc | Morgan Stanley | 2.684 | 0,00 |
| 271 | Dover Corp | Morgan Stanley | 8 | 0,00 |
| (2.057) | Dow Inc | Morgan Stanley | 970 | 0,00 |
| 1.167 | Doximity Inc Class A | JPMorgan Chase Bank | 4 | 0,00 |
| 3.609 | Doximity Inc Class A | Morgan Stanley | 2.186 | 0,00 |
| (211.094) | DR Horton Inc | Morgan Stanley | 5.150 | 0,00 |
| 15.486 | DraftKings Inc Class A | Morgan Stanley | 6.762 | 0,00 |
| 9.261 | Driven Brands Holdings Inc | Morgan Stanley | 1.225 | 0,00 |
| 2.286 | DT Midstream Inc | Morgan Stanley | 1.347 | 0,00 |
| 100 | Ducommun Inc | Morgan Stanley | 17 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (81) | Dun & Bradstreet Holdings Inc | Morgan Stanley | 6 | 0,00 |
| (155.193) | Dynatrace Inc | Morgan Stanley | 17.732 | 0,00 |
| (38.176) | Dyne Therapeutics Inc | Goldman Sachs International | 29.561 | 0,00 |
| (13.518) | Dyne Therapeutics Inc | JPMorgan Chase Bank | 11.131 | 0,00 |
| (188.249) | Dyne Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 34.319 | 0,00 |
| (9.414) | Dynex Capital Inc | Morgan Stanley | 2.185 | 0,00 |
| (220.061) | E.On SE | Goldman Sachs International | 21.229 | 0,00 |
| (76.913) | Eagle Materials Inc | Morgan Stanley | 18.760 | 0,00 |
| 438.800 | Eagle Materials Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (68.568) | East West Bancorp Inc | Morgan Stanley | 28.562 | 0,00 |
| (1.881) | Easterly Government Properties Inc | Morgan Stanley | 145 | 0,00 |
| (320.051) | Eaton Corp Plc | Goldman Sachs International | 3.226 | 0,00 |
| (1.067.482) | Eaton Corp Plc | Morgan Stanley | 19.432 | 0,00 |
| (506.105) | Eaton Corp Plc | JPMorgan Chase Bank | 13.585 | 0,00 |
| (124.955) | eBay Inc | Morgan Stanley | 9.042 | 0,00 |
| 2.986 | eBay Inc | Goldman Sachs International | 3 | 0,00 |
| 1.693 | Ecolab Inc | Morgan Stanley | 3.469 | 0,00 |
| 1.414 | Edison International | Morgan Stanley | 2.674 | 0,00 |
| (449) | Editas Medicine Inc | Morgan Stanley | 131 | 0,00 |
| 115.446 | EDP-Energias De Portugal | Goldman Sachs International | 1.116 | 0,00 |
| 135.905 | Edwards Lifesciences Corp | Goldman Sachs International | 21.976 | 0,00 |
| 1.746 | El Pollo Loco Holdings Inc | Morgan Stanley | 18 | 0,00 |
| 1.124 | Elastic NV | Morgan Stanley | 1.796 | 0,00 |
| (556) | Eldorado Gold Corp | Morgan Stanley | 131 | 0,00 |
| (110.910) | Electronic Arts Inc | Morgan Stanley | 15.665 | 0,00 |
| (791.358) | Elektrobras De Brazil | Goldman Sachs International | 18.073 | 0,00 |
| (118.997) | Elevance Health Inc | Morgan Stanley | 18.554 | 0,00 |
| (492.103) | elf Beauty Inc | JPMorgan Chase Bank | 72.227 | 0,01 |
| (39.030) | elf Beauty Inc | Morgan Stanley | 5.549 | 0,00 |
| (411.143) | elf Beauty Inc | Goldman Sachs International | 107.175 | 0,01 |
| (483.628) | Eli Lilly & Co | Goldman Sachs International | 30.790 | 0,00 |
| (85.246) | Eli Lilly & Co | Morgan Stanley | 19.345 | 0,00 |
| (1.677) | Ellington Financial Inc | Morgan Stanley | 246 | 0,00 |
| 5.400.000 | ELM BV for Swiss Prime Site AG | Société Générale | 816.004 | 0,05 |
| 15.800.000 | ELM BV for Swiss Re Ltd | Société Générale | 1.341.797 | 0,08 |
| 14.601 | Elme Communities | Morgan Stanley | 781 | 0,00 |
| 8.803 | Embecka Corp | Morgan Stanley | 4.697 | 0,00 |
| (83.040) | EMCOR Group Inc | Morgan Stanley | 3.590 | 0,00 |
| (127.447) | Emerson Electric Co | Morgan Stanley | 13.291 | 0,00 |
| 8.722 | Enbridge Inc | Morgan Stanley | 520 | 0,00 |
| 558 | Encompass Health Corp | Morgan Stanley | 285 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|------------|---------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 291.871 | Endesa SA | Goldman Sachs International | 1.650 | 0,00 |
| (138.973) | Enel SpA | Goldman Sachs International | 16.276 | 0,00 |
| 319.487 | Energizer Holdings Inc | Goldman Sachs International | 9.742 | 0,00 |
| 674.543 | Energizer Holdings Inc | JPMorgan Chase Bank | 29.619 | 0,00 |
| (2.124) | Energizer Holdings Inc | Morgan Stanley | 158 | 0,00 |
| (2.065) | Enerpac Tool Group Corp | Morgan Stanley | 561 | 0,00 |
| (312.784) | Engie SA | Goldman Sachs International | 8.126 | 0,00 |
| 3.920.548 | Eni SpA | Société Générale | 0 | 0,00 |
| 11.600.000 | Eni SpA | Nomura | 1.042.691 | 0,07 |
| 276.003 | EnLink Midstream LLC | Morgan Stanley | 6.266 | 0,00 |
| 467.405 | EnLink Midstream LLC | Goldman Sachs International | 25.190 | 0,00 |
| 702 | Enova International Inc | Morgan Stanley | 464 | 0,00 |
| 832.122 | Enovis Corp | Nomura | 0 | 0,00 |
| (2.195) | Enovis Corp | Morgan Stanley | 3.070 | 0,00 |
| (25.150) | Enphase Energy Inc | Morgan Stanley | 7.979 | 0,00 |
| (107.776) | Entergy Corp | Morgan Stanley | 19.058 | 0,00 |
| (259.000) | Envestnet Inc | Nomura | 0 | 0,00 |
| 2.751 | Envestnet Inc | Morgan Stanley | 1.336 | 0,00 |
| 409 | Enviri Corp | Morgan Stanley | 20 | 0,00 |
| (240.555) | Envista Holdings Corp | Goldman Sachs International | 3.322 | 0,00 |
| 65.540 | EOG Resources Inc | JPMorgan Chase Bank | 1.247 | 0,00 |
| 455.836 | EOG Resources Inc | Goldman Sachs International | 5.423 | 0,00 |
| 754 | EPAM Systems Inc | Morgan Stanley | 2.357 | 0,00 |
| (10.428) | EPR Properties | Morgan Stanley | 960 | 0,00 |
| 25.270 | EQT Corp | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (90.969) | EQT Corp | Morgan Stanley | 6.909 | 0,00 |
| (245.164) | Equifax Inc | JPMorgan Chase Bank | 91.761 | 0,01 |
| (78.828) | Equifax Inc | Goldman Sachs International | 25.107 | 0,00 |
| (42.813) | Equifax Inc | Morgan Stanley | 3.243 | 0,00 |
| 3.966.872 | Equinor ASA | Goldman Sachs International | 14.296 | 0,00 |
| 6.225.514 | Equinor ASA | JPMorgan Chase Bank | 56.227 | 0,01 |
| (11.981) | Equity Commonwealth | Morgan Stanley | 503 | 0,00 |
| (1.512) | Equity LifeStyle Properties Inc | Morgan Stanley | 880 | 0,00 |
| 7.600.000 | Erste Group Bank AG | Société Générale | 452.871 | 0,03 |
| (77.226) | Erste Group Bank AG | Goldman Sachs International | 7.327 | 0,00 |
| (217.763) | Erste Group Bank AG | JPMorgan Chase Bank | 19.865 | 0,00 |
| 2.572 | Essent Group Ltd | Morgan Stanley | 1.207 | 0,00 |
| (111.224) | Essential Utilities Inc | Morgan Stanley | 17.577 | 0,00 |
| (310.455) | Estee Lauder Cos Inc Class A | JPMorgan Chase Bank | 1.106 | 0,00 |
| (259.778) | Estee Lauder Cos Inc Class A | Morgan Stanley | 19.211 | 0,00 |
| (167.625) | Etsy Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|--|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (37) | Etsy Inc | Morgan Stanley | 30 | 0,00 |
| (58.052) | Euronet Worldwide Inc | Morgan Stanley | 9.506 | 0,00 |
| 2.421 | European Wax Center Inc Class A | Morgan Stanley | 41 | 0,00 |
| 562 | Evercore Inc Class A | Morgan Stanley | 1.882 | 0,00 |
| (113.260) | Evergy Inc | Morgan Stanley | 9.197 | 0,00 |
| 1.286 | EVERTEC Inc | Morgan Stanley | 69 | 0,00 |
| (653.881) | Evolent Health Inc Class A | Goldman Sachs International | 119.900 | 0,01 |
| 100 | EW Scripps Co Class A | Morgan Stanley | 48 | 0,00 |
| 2.930 | Exact Sciences Corp | Morgan Stanley | 13.408 | 0,00 |
| (105.842) | Exelixis Inc | Goldman Sachs International | 18.970 | 0,00 |
| (37.942) | Exelixis Inc | Morgan Stanley | 6.168 | 0,00 |
| (94.547) | Exelixis Inc | JPMorgan Chase Bank | 11.276 | 0,00 |
| 72.809 | Exelon Corp | Morgan Stanley | 4.964 | 0,00 |
| 3.755 | ExlService Holdings Inc | Morgan Stanley | 1.169 | 0,00 |
| 24.387 | Expedia Group Inc | Goldman Sachs International | 110 | 0,00 |
| (93.028) | Expedia Group Inc | Morgan Stanley | 48.586 | 0,01 |
| (836) | Expro Group Holdings NV | Morgan Stanley | 339 | 0,00 |
| (237) | Extra Space Storage Inc | Morgan Stanley | 137 | 0,00 |
| 2.377.675 | Exxon Mobil Corp | JPMorgan Chase Bank | 41.252 | 0,00 |
| 73.298 | Exxon Mobil Corp | Morgan Stanley | 3.281 | 0,00 |
| 722.190 | Fair Isaac Corp | Goldman Sachs International | 29.035 | 0,00 |
| (84.251) | Fair Isaac Corp | JPMorgan Chase Bank | 1.811 | 0,00 |
| (21.413) | Fair Isaac Corp | Morgan Stanley | 684 | 0,00 |
| (10.122) | Farmland Partners Inc | Morgan Stanley | 3.471 | 0,00 |
| 2.146 | FARO Technologies Inc | Morgan Stanley | 1.911 | 0,00 |
| (1.178) | Fastenal Co | Morgan Stanley | 508 | 0,00 |
| (1.066) | Fastly Inc Class A | Morgan Stanley | 607 | 0,00 |
| 9.989 | Fathom Digital Manufacturing Corporation | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 56 | Federal Agricultural Mortgage Corp | Morgan Stanley | 251 | 0,00 |
| 1.024 | Federal Signal Corp | Morgan Stanley | 224 | 0,00 |
| 938.588 | FedEx Corp | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 1.481 | Ferguson Plc | Morgan Stanley | 5.790 | 0,00 |
| (168) | Ferrari NV | Morgan Stanley | 505 | 0,00 |
| 6.318 | Fidelity National Financial Inc | Morgan Stanley | 6.366 | 0,00 |
| (151.050) | Fidelity National Information Services Inc | Morgan Stanley | 7.376 | 0,00 |
| (112.450) | Fifth Third Bancorp | Morgan Stanley | 39.059 | 0,00 |
| (101) | First Citizens BancShares Inc Class A | Morgan Stanley | 532 | 0,00 |
| 820 | First Foundation Inc | Morgan Stanley | 453 | 0,00 |
| 1.036 | First Hawaiian Inc | Morgan Stanley | 63 | 0,00 |
| 9.750 | First Horizon Corp | Morgan Stanley | 1.777 | 0,00 |
| (81.043) | First Industrial Realty Trust Inc | Morgan Stanley | 12.717 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|---|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (4.588) | First Interstate BancSystem Inc Class A | Morgan Stanley | 2.417 | 0,00 |
| (1.771) | First Majestic Silver Corp | Morgan Stanley | 125 | 0,00 |
| (701.733) | First Solar Inc | JPMorgan Chase Bank | 33.401 | 0,00 |
| (88.310) | First Solar Inc | Morgan Stanley | 13.438 | 0,00 |
| 75.083 | FirstEnergy Corp | Morgan Stanley | 625 | 0,00 |
| (971) | Fiserv Inc | Morgan Stanley | 422 | 0,00 |
| (849) | Five Below Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (392.488) | Five Below Inc | JPMorgan Chase Bank | 62.807 | 0,01 |
| 532 | Five9 Inc | Morgan Stanley | 367 | 0,00 |
| 120 | FleetCor Technologies Inc | Morgan Stanley | 701 | 0,00 |
| (290.880) | Flex Ltd | Morgan Stanley | 44.169 | 0,00 |
| (3.095) | Floor & Decor Holdings Inc Class A | Morgan Stanley | 2.444 | 0,00 |
| (352) | Flowers Foods Inc | Morgan Stanley | 2 | 0,00 |
| 354.544 | Flowers Foods Inc | Goldman Sachs International | 54.458 | 0,01 |
| (85.546) | Flowserve Corp | Morgan Stanley | 6.075 | 0,00 |
| 2.331 | Fluence Energy Inc | Morgan Stanley | 883 | 0,00 |
| (592.666) | Fluor Corp | Nomura | 0 | 0,00 |
| (329.725) | Flutter Entertainment Plc | Goldman Sachs International | 27.453 | 0,00 |
| (32.791) | Flutter Entertainment Plc | JPMorgan Chase Bank | 3.894 | 0,00 |
| (70.923) | Flutter Entertainment Plc | Morgan Stanley | 8.566 | 0,00 |
| 2.096 | FMC Corp | Morgan Stanley | 5.475 | 0,00 |
| (5.396) | FNB Corp | Morgan Stanley | 700 | 0,00 |
| (389.883) | Fomento Economico Mexicano SAB de CV | Goldman Sachs International | 33.091 | 0,00 |
| (396.560) | Fomento Economico Mexicano SAB de CV | JPMorgan Chase Bank | 6.365 | 0,00 |
| (145.172) | Foot Locker Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (1.263) | Foot Locker Inc | Morgan Stanley | 733 | 0,00 |
| (4.627.089) | Foran Mining Corp | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (434) | Forestar Group Inc | Morgan Stanley | 591 | 0,00 |
| (78.021) | Fortinet Inc | Morgan Stanley | 13.854 | 0,00 |
| 209.122 | Fortinet Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (78.330) | Fortrea Holdings Inc | Morgan Stanley | 20.828 | 0,00 |
| (2.334) | Fortune Brands Home & Security Inc | Morgan Stanley | 3.111 | 0,00 |
| (5.206.492) | Foschini Group Ltd | Goldman Sachs International | 39.204 | 0,00 |
| (1.523.984) | Foschini Group Ltd | Morgan Stanley | 17.892 | 0,00 |
| (1.340.423) | Foschini Group Ltd | JPMorgan Chase Bank | 13.192 | 0,00 |
| (1.295) | Four Corners Property Trust Inc | Morgan Stanley | 35 | 0,00 |
| 54.960 | Fox Corp Class A | Morgan Stanley | 8.286 | 0,00 |
| 220 | Franklin Covey Co | Morgan Stanley | 415 | 0,00 |
| 1.030 | Franklin Electric Co Inc | Morgan Stanley | 565 | 0,00 |
| (182.434) | Freeport-McMoRan Inc | Goldman Sachs International | 87.938 | 0,01 |
| (330.025) | Freeport-McMoRan Inc | JPMorgan Chase Bank | 2.702 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|--------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (91.923) | Freshpet Inc | Morgan Stanley | 12 | 0,00 |
| (338.709) | Freshpet Inc | JPMorgan Chase Bank | 28.858 | 0,00 |
| (1.288.273) | Freshpet Inc | Goldman Sachs International | 322.557 | 0,02 |
| (2.014) | Freshworks Inc Class A | Morgan Stanley | 978 | 0,00 |
| 567 | Frontier Group Holdings Inc | Morgan Stanley | 114 | 0,00 |
| (289) | FTAI Aviation Ltd | Morgan Stanley | 108 | 0,00 |
| (10.551) | Fulcrum Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 6.446 | 0,00 |
| (39.440) | Fulcrum Therapeutics Inc | JPMorgan Chase Bank | 31.457 | 0,00 |
| (43.645) | Fulcrum Therapeutics Inc | Goldman Sachs International | 16.195 | 0,00 |
| (572) | Fulgent Genetics Inc | Morgan Stanley | 255 | 0,00 |
| (3.182) | Fulton Financial Corp | Morgan Stanley | 675 | 0,00 |
| (56.920) | GameStop Corp Class A | Morgan Stanley | 23.729 | 0,00 |
| (658.699) | Gap Inc | JPMorgan Chase Bank | 35.602 | 0,00 |
| (784) | Garmin Ltd | Morgan Stanley | 51 | 0,00 |
| 771 | Garrett Motion Inc | Morgan Stanley | 1.070 | 0,00 |
| (51.763) | Gartner Inc | JPMorgan Chase Bank | 14.403 | 0,00 |
| (69.541) | Gates Industrial Corp Plc | Morgan Stanley | 14.231 | 0,00 |
| (124.865) | GE HealthCare Technologies Inc | Morgan Stanley | 18.693 | 0,00 |
| (97.341) | Gen Digital Inc | Morgan Stanley | 31.768 | 0,00 |
| 228 | Generac Holdings Inc | Morgan Stanley | 57 | 0,00 |
| 947 | General Electric Co | Morgan Stanley | 2.170 | 0,00 |
| 2.352 | General Mills Inc | Morgan Stanley | 1.350 | 0,00 |
| (2.086.919) | General Motors Co | Morgan Stanley | 19.839 | 0,00 |
| 449 | Genesco Inc | Morgan Stanley | 545 | 0,00 |
| 87.219 | Genmab A/S | Goldman Sachs International | 17.089 | 0,00 |
| 1.442 | Genpact Ltd | Morgan Stanley | 126 | 0,00 |
| (9) | Gentex Corp | Morgan Stanley | 2 | 0,00 |
| 67 | G-III Apparel Group Ltd | Morgan Stanley | 23 | 0,00 |
| 937 | Gildan Activewear Inc | Morgan Stanley | 321 | 0,00 |
| (42.473) | Gilead Sciences Inc | Morgan Stanley | 3.373 | 0,00 |
| 3.009 | Gitlab Inc Class A | Morgan Stanley | 916 | 0,00 |
| (916) | Glacier Bancorp Inc | Morgan Stanley | 889 | 0,00 |
| (973) | Glaukos Corp | Morgan Stanley | 715 | 0,00 |
| (1.791) | Global Medical REIT Inc | Morgan Stanley | 196 | 0,00 |
| (145.618) | Global Payments Inc | Morgan Stanley | 16.544 | 0,00 |
| (79.036) | Global-e Online Ltd | Goldman Sachs International | 21.440 | 0,00 |
| 19.839 | GlobalFoundries Inc | Morgan Stanley | 707 | 0,00 |
| 1.806 | Globus Medical Inc Class A | Morgan Stanley | 1.664 | 0,00 |
| (126.232) | GoDaddy Inc Class A | Morgan Stanley | 10.301 | 0,00 |
| (68.671) | GoDaddy Inc Class A | Goldman Sachs International | 29.127 | 0,00 |
| (118.004) | Goldman Sachs Group Inc | Morgan Stanley | 31.419 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|---|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (467) | Graco Inc | Morgan Stanley | 42 | 0,00 |
| (72.822) | Grand Canyon Education Inc | Morgan Stanley | 8.684 | 0,00 |
| (531.858) | Grifols SA | Goldman Sachs International | 260.332 | 0,02 |
| (560.350) | Grifols SA | JPMorgan Chase Bank | 87.660 | 0,01 |
| 875.378 | Grocery Outlet Holding Corp | JPMorgan Chase Bank | 39.751 | 0,00 |
| 42.205 | Grocery Outlet Holding Corp | Morgan Stanley | 2.564 | 0,00 |
| (1.758.997) | Group 1 Automotive Inc | Morgan Stanley | 507.815 | 0,03 |
| (433.217) | GSK Plc | JPMorgan Chase Bank | 3.022 | 0,00 |
| (682.162) | GSK Plc | Goldman Sachs International | 7.350 | 0,00 |
| 911.125 | Guardant Health Inc | Nomura | 0 | 0,00 |
| 829 | Guidewire Software Inc | Morgan Stanley | 2.001 | 0,00 |
| (1.526) | GXO Logistics Inc | Morgan Stanley | 718 | 0,00 |
| 246.357 | H Lundbeck A/S | Goldman Sachs International | 1.458 | 0,00 |
| (71.119) | H&R Block Inc | Morgan Stanley | 17.626 | 0,00 |
| 4.988 | Hain Celestial Group Inc | Morgan Stanley | 1.990 | 0,00 |
| 124.159 | Halliburton Co | Goldman Sachs International | 7.391 | 0,00 |
| (100.410) | Halliburton Co | Morgan Stanley | 5.470 | 0,00 |
| 18.226 | Halliburton Co | JPMorgan Chase Bank | 54 | 0,00 |
| 73.102 | Halozyme Therapeutics Inc | Goldman Sachs International | 5.606 | 0,00 |
| 1.230 | Halozyme Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 6 | 0,00 |
| (189) | Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital Inc | Morgan Stanley | 153 | 0,00 |
| 282.878 | Hannover Rueckversicheru SE | Goldman Sachs International | 1.398 | 0,00 |
| (70.502) | Harley-Davidson Inc | Morgan Stanley | 31.104 | 0,00 |
| 515 | Harmonic Inc | Morgan Stanley | 424 | 0,00 |
| 272 | Harrow Inc | Morgan Stanley | 270 | 0,00 |
| 8.157 | HashiCorp Inc Class A | Morgan Stanley | 5.003 | 0,00 |
| 2.594 | HCA Healthcare Inc | Morgan Stanley | 11.755 | 0,00 |
| 100 | Health Catalyst Inc | Morgan Stanley | 7 | 0,00 |
| 2.272 | Healthcare Services Group Inc | Morgan Stanley | 460 | 0,00 |
| (122.731) | Healthpeak Properties Inc | Morgan Stanley | 16.897 | 0,00 |
| 192 | HealthStream Inc | Morgan Stanley | 112 | 0,00 |
| 324.497 | Helmerich & Payne | Goldman Sachs International | 10.158 | 0,00 |
| 321.470 | Helmerich & Payne | JPMorgan Chase Bank | 12.309 | 0,00 |
| (282) | Helmerich & Payne Inc | Morgan Stanley | 70 | 0,00 |
| (169) | Henry Schein Inc | Morgan Stanley | 89 | 0,00 |
| (695.633) | Henry Schein Inc | Goldman Sachs International | 37.870 | 0,00 |
| 191 | Herbalife Ltd | Morgan Stanley | 0 | 0,00 |
| 3.585.000 | Herbalife Ltd | Nomura | 403.166 | 0,03 |
| 1.780.290 | Herbalife Nutrition Ltd | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 4.198 | Hershey Co | Morgan Stanley | 22.213 | 0,00 |
| 354.465 | Hershey Co | JPMorgan Chase Bank | 4.539 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|-----------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (80.905) | Hertz Global Holdings Inc | Morgan Stanley | 15.220 | 0,00 |
| 747.009 | Hess Corp | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 9.712 | Hess Midstream LP Class A | Morgan Stanley | 1.308 | 0,00 |
| 25.292 | Hewlett Packard Enterprise Co | Morgan Stanley | 118 | 0,00 |
| 2.163 | Hexcel Corp | Morgan Stanley | 2.195 | 0,00 |
| (131.478) | HF Sinclair Corp | Morgan Stanley | 1.238 | 0,00 |
| (92.525) | Highwoods Properties Inc | Morgan Stanley | 22.432 | 0,00 |
| (1.068) | Hillman Solutions Corp | Morgan Stanley | 69 | 0,00 |
| 3.050 | Hilltop Holdings Inc | Morgan Stanley | 1.989 | 0,00 |
| (596) | Hilton Grand Vacations Inc | Morgan Stanley | 546 | 0,00 |
| 3.618 | Hilton Worldwide Holdings Inc | Morgan Stanley | 12.107 | 0,00 |
| (11.113) | Hims & Hers Health Inc | Morgan Stanley | 3.013 | 0,00 |
| (52.616) | Hims & Hers Health Inc | Goldman Sachs International | 18.090 | 0,00 |
| (27.409) | Hims & Hers Health Inc | JPMorgan Chase Bank | 3.528 | 0,00 |
| 4.662 | Hologic Inc | Morgan Stanley | 3.132 | 0,00 |
| (985) | Home BancShares Inc | Morgan Stanley | 156 | 0,00 |
| (121.662) | Home Depot Inc | Morgan Stanley | 20.014 | 0,00 |
| 488.195 | Home Reit Plc | Bank of America Merrill Lynch | 622 | 0,00 |
| 183 | Honeywell International Inc | Morgan Stanley | 318 | 0,00 |
| 4.307 | Hope Bancorp Inc | Morgan Stanley | 214 | 0,00 |
| 87.626 | Hormel Foods Corp | Morgan Stanley | 10.350 | 0,00 |
| 54.767.340 | Hosiden Corp | Société Générale | 0 | 0,00 |
| (128) | Houlihan Lokey Inc | Morgan Stanley | 59 | 0,00 |
| (86.620) | Howard Hughes Holdings Inc | Morgan Stanley | 15.116 | 0,00 |
| (1.010.001) | Howmet Aerospace Inc | JPMorgan Chase Bank | 84.005 | 0,01 |
| (311.220) | Howmet Aerospace Inc | Morgan Stanley | 6.715 | 0,00 |
| (316.171) | Howmet Aerospace Inc | Goldman Sachs International | 13.385 | 0,00 |
| 391.668 | HP Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (123.751) | HP Inc | Morgan Stanley | 4.448 | 0,00 |
| 854 | Hubbell Inc | Morgan Stanley | 5.654 | 0,00 |
| (82.748) | HubSpot Inc | JPMorgan Chase Bank | 23.308 | 0,00 |
| 1.709 | Humana Inc | Morgan Stanley | 4.791 | 0,00 |
| 34.662 | Humana Inc | JPMorgan Chase Bank | 3.142 | 0,00 |
| (110.051) | Huntington Ingalls Industries | Morgan Stanley | 31.425 | 0,00 |
| 440 | Huntington Ingalls Industries Inc | Morgan Stanley | 2.288 | 0,00 |
| (45.187) | Huntsman Corp | Morgan Stanley | 2.663 | 0,00 |
| (253) | Hyatt Hotels Corp Class A | Morgan Stanley | 34 | 0,00 |
| 100 | I3 Verticals Inc Class A | Morgan Stanley | 1 | 0,00 |
| 54.800 | ICU Medical Inc | Morgan Stanley | 5.726 | 0,00 |
| 510 | IDEX Corp | Morgan Stanley | 1.951 | 0,00 |
| (115.258) | IDEXX Laboratories Inc | Morgan Stanley | 43.265 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|---------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 5.028.110 | Idorsia Ltd | Société Générale | 394.507 | 0,03 |
| (100) | IMAX Corp | Morgan Stanley | 14 | 0,00 |
| (178.591) | Immunocore Holdings Plc | JPMorgan Chase Bank | 41.814 | 0,00 |
| (90.313) | Immunocore Holdings Plc | Goldman Sachs International | 7.369 | 0,00 |
| (162.943) | Immunocore Holdings Plc | Morgan Stanley | 49.250 | 0,01 |
| (139.165) | Imperial Oil Ltd | Goldman Sachs International | 480 | 0,00 |
| 715.420 | Imperial Oil Ltd | Morgan Stanley | 5.884 | 0,00 |
| 414.630 | Imperial Oil Ltd | JPMorgan Chase Bank | 2.372 | 0,00 |
| 546 | Inari Medical Inc | Morgan Stanley | 714 | 0,00 |
| (42.707) | Incyte Corp | Morgan Stanley | 9.085 | 0,00 |
| (8.072) | Independence Realty Trust Inc | Morgan Stanley | 336 | 0,00 |
| 111 | Independent Bank Group Inc | Morgan Stanley | 96 | 0,00 |
| (319.593) | ING Groep NV | Goldman Sachs International | 44.854 | 0,01 |
| (84.851) | Ingredion Inc | Morgan Stanley | 6.120 | 0,00 |
| (24.744) | Ingredion Inc | JPMorgan Chase Bank | 2.461 | 0,00 |
| (81.752) | Ingredion Inc | Goldman Sachs International | 6.423 | 0,00 |
| (10.360) | Inhibrx Inc | Goldman Sachs International | 14.652 | 0,00 |
| (63.122) | Inhibrx Inc | JPMorgan Chase Bank | 55.907 | 0,01 |
| 606 | Innovid Corp | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (175) | Insight Enterprises Inc | Morgan Stanley | 837 | 0,00 |
| (166.759) | Insmed Inc | Morgan Stanley | 76.489 | 0,01 |
| 4.000.000 | Insmed Inc | Nomura | 1.194.881 | 0,08 |
| (20.502) | Insmed Inc | Goldman Sachs International | 3.580 | 0,00 |
| 1.980 | Insperty Inc | Morgan Stanley | 987 | 0,00 |
| 83 | Inspire Medical Systems Inc | Morgan Stanley | 1.120 | 0,00 |
| (150.537) | Insulet Corp | Morgan Stanley | 44.277 | 0,00 |
| (14.673) | Insulet Corp | JPMorgan Chase Bank | 13 | 0,00 |
| 1.903.432 | Insulet Corp | Nomura | 0 | 0,00 |
| (294.335) | Insulet Corp | Goldman Sachs International | 41.730 | 0,00 |
| 1.485 | Insulet Corp | Morgan Stanley | 9.611 | 0,00 |
| (79.497) | Integra Lifesciences Holding | Morgan Stanley | 12.922 | 0,00 |
| 2.829 | Integra LifeSciences Holdings Corp | Morgan Stanley | 183 | 0,00 |
| (43.712) | Intel Corp | Morgan Stanley | 19.673 | 0,00 |
| (228.134) | Inter Parfums Inc | Goldman Sachs International | 6.688 | 0,00 |
| (39.373) | Inter Parfums Inc | Morgan Stanley | 3.816 | 0,00 |
| (254.861) | Inter Parfums Inc | JPMorgan Chase Bank | 3.844 | 0,00 |
| (84.542) | Interactive Brokers Group Inc Class A | Morgan Stanley | 6.776 | 0,00 |
| (97.545) | Intercontinental Exchange Inc | Morgan Stanley | 8.986 | 0,00 |
| (206.422) | Intercontinental Exchange Inc | Goldman Sachs International | 28.686 | 0,00 |
| (379.509) | Intercontinental Exchange Inc | JPMorgan Chase Bank | 50.440 | 0,01 |
| 7.482.526 | InterDigital Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------|--|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 6.300.000 | InterDigital Inc | Nomura | 1.831.355 | 0,11 |
| (634) | InterDigital Inc | Morgan Stanley | 1.172 | 0,00 |
| 4.136.499 | International Consolidated Airlines Group SA | Société Générale | 453.056 | 0,03 |
| (124.520) | International Flavors & Fragrances Inc | Goldman Sachs International | 25.984 | 0,00 |
| (339.747) | International Flavors & Fragrances Inc | Morgan Stanley | 67.701 | 0,01 |
| (1.125) | International Paper Co | Morgan Stanley | 367 | 0,00 |
| (5.188) | International Seaways Inc | Morgan Stanley | 6.035 | 0,00 |
| (1.596) | Interpublic Group of Cos Inc | Morgan Stanley | 281 | 0,00 |
| 11.200.000 | Intesa Sanpaolo SpA | Société Générale | 208.350 | 0,02 |
| (61.777) | Intra-Cellular Therapies Inc | JPMorgan Chase Bank | 6.795 | 0,00 |
| (19.151) | Intuit Inc | Morgan Stanley | 1.442 | 0,00 |
| (8.913) | Intuit Inc | Goldman Sachs International | 1.696 | 0,00 |
| (56.443) | Intuit Inc | JPMorgan Chase Bank | 16.569 | 0,00 |
| (67.968) | Ionis Pharmaceuticals Inc | JPMorgan Chase Bank | 516 | 0,00 |
| (1.004.925) | Ionis Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs International | 37.853 | 0,00 |
| (3.534) | IonQ Inc | Morgan Stanley | 5.126 | 0,00 |
| (815.720) | IQVIA Holdings Inc | Goldman Sachs International | 44.519 | 0,00 |
| 3.628 | Iridium Communications Inc | Morgan Stanley | 3.787 | 0,00 |
| (125.859) | Iron Mountain Inc | Morgan Stanley | 13.342 | 0,00 |
| 19.412 | Ironwood Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 7.082 | 0,00 |
| 966.746 | Italgas SpA | Société Générale | 0 | 0,00 |
| (1.164.729) | Itau Unibanco Holding SA | Goldman Sachs International | 13.412 | 0,00 |
| 2.437 | Itron Inc | Morgan Stanley | 1.853 | 0,00 |
| 1.539.580 | ITT Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (5.012) | Ivanhoe Electric Inc | Morgan Stanley | 1.898 | 0,00 |
| (1.958) | Jabil Inc | Morgan Stanley | 5.381 | 0,00 |
| (2.937) | Jackson Financial Inc Class A | Morgan Stanley | 3.043 | 0,00 |
| 123.495.259 | JAFCO Group Co Ltd | Nomura | 0 | 0,00 |
| (15.733) | Janus Henderson Group Plc | Morgan Stanley | 5.139 | 0,00 |
| 12.004 | Jaws Mustang | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (77) | JB Hunt Transport Services Inc | Morgan Stanley | 174 | 0,00 |
| (5.487) | JBG SMITH Properties | Morgan Stanley | 1.211 | 0,00 |
| 66.027 | JD.com Inc | Morgan Stanley | 12.172 | 0,00 |
| (18.999.600) | JD.com Inc Class A | Morgan Stanley | 0 | 0,00 |
| (73.485) | Jefferies Financial Group Inc | Morgan Stanley | 27.657 | 0,00 |
| 372.885.710 | JFE Holdings Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (1.229.720) | JM Smucker Co | Morgan Stanley | 146.074 | 0,01 |
| (1.078.642) | JM Smucker Co | Goldman Sachs International | 56.422 | 0,00 |
| (503.148) | JM Smucker Co | JPMorgan Chase Bank | 51.408 | 0,01 |
| (808.206) | Johnson & Johnson | Goldman Sachs International | 23.446 | 0,00 |
| 528.977 | Johnson & Johnson | Morgan Stanley | 3.977 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|--|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 2.503 | Kaman Corp | Morgan Stanley | 799 | 0,00 |
| (83.769) | KBC Group NV | Goldman Sachs International | 4.955 | 0,00 |
| 653 | Kellanova | Morgan Stanley | 37 | 0,00 |
| 1.983 | Kemper Corp | Morgan Stanley | 1.027 | 0,00 |
| (743) | Kennametal Inc | Morgan Stanley | 101 | 0,00 |
| 10.565 | Kenvue Inc | Goldman Sachs International | 341 | 0,00 |
| (328.021) | Kenvue Inc | Morgan Stanley | 2.409 | 0,00 |
| 127.098 | Kering SA | Goldman Sachs International | 5.426 | 0,00 |
| (1.582.107) | Keurig Dr Pepper Inc | Morgan Stanley | 157.840 | 0,01 |
| (208.907) | Keurig Dr Pepper Inc | Goldman Sachs International | 107 | 0,00 |
| (411.576) | Keurig Dr Pepper Inc | JPMorgan Chase Bank | 29.140 | 0,00 |
| 813 | Keysight Technologies Inc | Morgan Stanley | 604 | 0,00 |
| (75.863) | Kilroy Realty Corp | Morgan Stanley | 23.889 | 0,00 |
| 471.513 | Kimberly-Clark Corp | JPMorgan Chase Bank | 1.404 | 0,00 |
| 281.046 | Kimberly-Clark Corp | Goldman Sachs International | 1.343 | 0,00 |
| 747.359 | Kimberly-Clark Corp | Morgan Stanley | 42.928 | 0,00 |
| 18.457 | Kinder Morgan Inc | Morgan Stanley | 564 | 0,00 |
| (185) | Kinetik Holdings Inc | Morgan Stanley | 74 | 0,00 |
| (51) | Kinross Gold Corp | Morgan Stanley | 1 | 0,00 |
| 47.479 | Kinsale Capital Group Inc | Morgan Stanley | 6.742 | 0,00 |
| (106.237) | KLA Corp | Morgan Stanley | 39.643 | 0,00 |
| 26.661 | Klaviyo Inc Class A | Goldman Sachs International | 3.791 | 0,00 |
| 1.955.305 | Klepierre SA | Société Générale | 0 | 0,00 |
| (67.219) | Knight-Swift Transportation Holdings Inc | Goldman Sachs International | 195 | 0,00 |
| (7.515) | Knight-Swift Transportation Holdings Inc | Morgan Stanley | 246 | 0,00 |
| (397.549) | Knight-Swift Transportation Holdings Inc | JPMorgan Chase Bank | 13.560 | 0,00 |
| 732.366 | Koninklijke Ahold Delhaize NV | JPMorgan Chase Bank | 16.251 | 0,00 |
| 209.317 | Koninklijke Ahold Delhaize NV | Goldman Sachs International | 3.639 | 0,00 |
| 352 | Kontoor Brands Inc | Morgan Stanley | 809 | 0,00 |
| 273 | Korn Ferry | Morgan Stanley | 137 | 0,00 |
| (5.776) | Kosmos Energy Ltd | Morgan Stanley | 1.827 | 0,00 |
| (711) | Kratos Defense & Security Solutions Inc | Morgan Stanley | 121 | 0,00 |
| (249.079) | Kroger Co | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 580.283 | Kroger Co | Morgan Stanley | 9.426 | 0,00 |
| 3.257 | Kyndryl Holdings Inc | Morgan Stanley | 1.984 | 0,00 |
| 5.700.000 | Lagfin SCA | Société Générale | 343.501 | 0,02 |
| 2.900.620 | Lam Research Corp | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (103.709) | Lam Research Corp | Morgan Stanley | 35.534 | 0,00 |
| (229.457) | Lamb Weston Holdings Inc | Morgan Stanley | 30.977 | 0,00 |
| (406.019) | Lamb Weston Holdings Inc | Goldman Sachs International | 20.413 | 0,00 |
| (987.337) | Lamb Weston Holdings Inc | JPMorgan Chase Bank | 122.009 | 0,02 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|--|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (364.130) | Las Vegas Sands Corp | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 4.486 | Las Vegas Sands Corp | Morgan Stanley | 3.728 | 0,00 |
| (84.460) | Lazard Ltd Class A | Morgan Stanley | 13.256 | 0,00 |
| (125.318) | Lear Corp | Morgan Stanley | 8.393 | 0,00 |
| (76.505) | Legal & General Group Plc | Goldman Sachs International | 3.088 | 0,00 |
| 8.501 | Legalzoom.com Inc | Morgan Stanley | 435 | 0,00 |
| 30.472 | Legend Biotech Corp | Goldman Sachs International | 236 | 0,00 |
| 68.275 | Legend Biotech Corp | JPMorgan Chase Bank | 1.413 | 0,00 |
| 399 | Leidos Holdings Inc | Morgan Stanley | 98 | 0,00 |
| (2.884) | Lemonade Inc | Morgan Stanley | 3.730 | 0,00 |
| 2.205 | Lennar Corp Class A | Morgan Stanley | 1.894 | 0,00 |
| 320 | Lennox International Inc | Morgan Stanley | 2.340 | 0,00 |
| 59.251 | Liberty Broadband Corp Class C | Morgan Stanley | 1.468 | 0,00 |
| (10.488) | Liberty Energy Inc | Morgan Stanley | 6.303 | 0,00 |
| 2.005 | Liberty Latin America Ltd Class C | Morgan Stanley | 361 | 0,00 |
| (279) | Liberty Media Corp-Liberty Formula One | Morgan Stanley | 149 | 0,00 |
| 9.494 | Life Time Group Holdings Inc | Morgan Stanley | 678 | 0,00 |
| 654 | Lightspeed Commerce Inc | Morgan Stanley | 715 | 0,00 |
| (79.939) | Lincoln National Corp | Morgan Stanley | 11.449 | 0,00 |
| 2.434 | Lindblad Expeditions Holdings Inc | Morgan Stanley | 1.512 | 0,00 |
| 4 | Lions Gate Entertainment Corp Class B | Morgan Stanley | 1 | 0,00 |
| (976.406) | Lithia Motors Inc Class A | Morgan Stanley | 57.348 | 0,01 |
| 28 | Lithium Americas Argentina Corp | Morgan Stanley | 3 | 0,00 |
| 20.824.073 | Live Nation Entertainment Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (127.535) | Live Nation Entertainment Inc | Morgan Stanley | 14.513 | 0,00 |
| 38.500.000 | Live Nation Entertainment Inc | Société Générale | 3.685.886 | 0,23 |
| 716 | LivePerson Inc | Morgan Stanley | 310 | 0,00 |
| 1.000.000 | Lloyds Banking Group Plc | Société Générale | 75.007 | 0,00 |
| 2.997 | Lockheed Martin Corp | Morgan Stanley | 21.607 | 0,00 |
| 1.737 | Loews Corp | Morgan Stanley | 2.149 | 0,00 |
| 802.905 | Louisiana-Pacific Corp | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 416.071 | Lowe's Cos Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 1.310 | LPL Financial Holdings Inc | Morgan Stanley | 5.492 | 0,00 |
| (752.063) | LPP SA | Goldman Sachs International | 31.062 | 0,00 |
| (1.135.139) | LPP SA | JPMorgan Chase Bank | 36.567 | 0,00 |
| 28.547 | Lucid Group Inc | Morgan Stanley | 6.880 | 0,00 |
| 1.445.141 | Lululemon Athletica Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (104.698) | Lumentum Holdings Inc | Morgan Stanley | 22.156 | 0,00 |
| 6.532.910 | Lyft Inc Class A | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 191.171 | LyondellBasell Industries NV Class A | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (2.179) | M&T Bank Corp | Morgan Stanley | 345 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|------------|--|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (4.057) | Macerich Co | Morgan Stanley | 392 | 0,00 |
| (6.410) | Madison Square Garden Entertainment Corp | Morgan Stanley | 241 | 0,00 |
| (2.957) | MAG Silver Corp | Morgan Stanley | 701 | 0,00 |
| (65) | Magnite Inc | Morgan Stanley | 16 | 0,00 |
| (2.190) | Magnolia Oil & Gas Corp Class A | Morgan Stanley | 1.780 | 0,00 |
| 67.041 | Magnolia Oil & Gas Corp Class A | Goldman Sachs International | 4.142 | 0,00 |
| 363.359 | Magnolia Oil & Gas Corp Class A | JPMorgan Chase Bank | 1.101 | 0,00 |
| (110.967) | Manhattan Associates Inc | Morgan Stanley | 9.909 | 0,00 |
| (80.726) | ManpowerGroup Inc | Morgan Stanley | 8.259 | 0,00 |
| 4.293 | Manulife Financial Corp | Morgan Stanley | 693 | 0,00 |
| 50.565 | Maplebear Inc | Morgan Stanley | 2.344 | 0,00 |
| 126.539 | Marathon Oil Corp | JPMorgan Chase Bank | 2.309 | 0,00 |
| 948.564 | Marathon Oil Corp | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 279.704 | Marathon Petroleum Corp | Goldman Sachs International | 2.962 | 0,00 |
| 1.330 | MarketAxess Holdings Inc | Morgan Stanley | 14.562 | 0,00 |
| 9.971 | Marqeta Inc Class A | Morgan Stanley | 714 | 0,00 |
| 4.030.076 | Marriott Vacations Worldwide Corp | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 4.197 | Marriott Vacations Worldwide Corp | Morgan Stanley | 116 | 0,00 |
| (525) | Marvell Technology Inc | Morgan Stanley | 320 | 0,00 |
| (109.405) | Masco Corp | Morgan Stanley | 30.538 | 0,00 |
| (498) | Masterbrand Inc | Morgan Stanley | 120 | 0,00 |
| (154.054) | Mastercard Inc Class A | Morgan Stanley | 15.848 | 0,00 |
| (290.642) | Mastercard Inc Class A | Goldman Sachs International | 14.453 | 0,00 |
| (442.722) | Mastercard Inc Class A | JPMorgan Chase Bank | 34.274 | 0,00 |
| 538.445 | Matador Resources Co | JPMorgan Chase Bank | 19.450 | 0,00 |
| (1.403) | Matador Resources Co | Morgan Stanley | 1.369 | 0,00 |
| 12.333.162 | Match Group Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 41 | Match Group Inc | Morgan Stanley | 13 | 0,00 |
| (834) | Mattel Inc | Morgan Stanley | 26 | 0,00 |
| (166) | MaxLinear Inc Class A | Morgan Stanley | 70 | 0,00 |
| (252.544) | McCormick & Co Inc | Goldman Sachs International | 618 | 0,00 |
| 1.112 | McCormick & Co Inc | Morgan Stanley | 506 | 0,00 |
| 122 | McKesson Corp | Morgan Stanley | 886 | 0,00 |
| 99 | MDC Holdings Inc | Morgan Stanley | 155 | 0,00 |
| (78.368) | MDU Resources Group Inc | Morgan Stanley | 6.382 | 0,00 |
| 14.064 | Mediobanca SpA | JPMorgan Chase Bank | 104 | 0,00 |
| 207.961 | Mediobanca SpA | Goldman Sachs International | 11.717 | 0,00 |
| (74.129) | Medpace Holdings Inc | Morgan Stanley | 20.696 | 0,00 |
| (889.148) | Medtronic Plc | Goldman Sachs International | 54.616 | 0,01 |
| 7.000.000 | Meituan | Nomura | 257.778 | 0,02 |
| 31.700.000 | Meituan | Société Générale | 902.481 | 0,06 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------|---------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (59.170.260) | Meituan Class B | Nomura | 0 | 0,00 |
| 811.839 | Mercari Inc | JPMorgan Chase Bank | 201 | 0,00 |
| 2.945.027 | Mercari Inc | Goldman Sachs International | 513 | 0,00 |
| 3.612.874 | Mercari Inc | Morgan Stanley | 3.398 | 0,00 |
| (944) | Mercer International Inc | Morgan Stanley | 28 | 0,00 |
| (940.081) | Merck & Co Inc | Goldman Sachs International | 43.441 | 0,00 |
| (126.268) | Merck & Co Inc | Morgan Stanley | 13.625 | 0,00 |
| 17.280 | Merck KGaA | JPMorgan Chase Bank | 277 | 0,00 |
| 52.528 | Merck KGaA | Morgan Stanley | 1.118 | 0,00 |
| 53.584 | Merck KGaA | Goldman Sachs International | 1.178 | 0,00 |
| (379.993) | Merus NV | Goldman Sachs International | 93.694 | 0,01 |
| (505.961) | Meta Platforms Inc Class A | Morgan Stanley | 69.717 | 0,01 |
| 1.534.431 | Meta Platforms Inc Class A | Goldman Sachs International | 52.351 | 0,00 |
| (300.887) | Meta Platforms Inc Class A | JPMorgan Chase Bank | 31.955 | 0,00 |
| (4.168) | MetLife Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (87.683) | MetLife Inc | Morgan Stanley | 22.185 | 0,00 |
| 441 | Mettler-Toledo International Inc | Morgan Stanley | 5.437 | 0,00 |
| (76.579) | Mgic Investment Corp | Morgan Stanley | 12.969 | 0,00 |
| 8.117 | MGM Resorts International | Morgan Stanley | 4.161 | 0,00 |
| 367.868 | Microchip Technology Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (111.929) | Micron Technology Inc | Morgan Stanley | 31.871 | 0,00 |
| 2.554.406 | Micron Technology Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (450.318) | Microsoft Corp | JPMorgan Chase Bank | 24.858 | 0,00 |
| 525.360 | Microsoft Corp | Goldman Sachs International | 2.179 | 0,00 |
| (781.132) | Microsoft Corp | Morgan Stanley | 81.460 | 0,01 |
| 437 | Mid-America Apartment Communities Inc | Morgan Stanley | 191 | 0,00 |
| (1.123.024) | Middleby Corp | Nomura | 0 | 0,00 |
| (202) | MillerKnoll Inc | Morgan Stanley | 274 | 0,00 |
| 100 | Minerals Technologies Inc | Morgan Stanley | 307 | 0,00 |
| (107) | Mirion Technologies Inc | Morgan Stanley | 4 | 0,00 |
| (21.917) | Mirum Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs International | 2.867 | 0,00 |
| 2.014 | Mister Car Wash Inc | Morgan Stanley | 300 | 0,00 |
| (85) | MKS Instruments Inc | Morgan Stanley | 213 | 0,00 |
| 1.383 | Modine Manufacturing Co | Morgan Stanley | 2.092 | 0,00 |
| 23.395.082 | MOL Hungarian Oil & Gas Plc | Morgan Stanley | 2.624 | 0,00 |
| 41.160.428 | MOL Hungarian Oil & Gas Plc | Goldman Sachs International | 1.331 | 0,00 |
| (483) | Molson Coors Beverage Co Class B | Morgan Stanley | 110 | 0,00 |
| 109.278 | Molson Coors Beverage Co Class B | Goldman Sachs International | 1.804 | 0,00 |
| 242 | Monarch Casino & Resort Inc | Morgan Stanley | 111 | 0,00 |
| (233.752) | Moncler SpA Class A | Goldman Sachs International | 1.551 | 0,00 |
| (239.354) | Moncler SpA Class A | Morgan Stanley | 14.940 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|---|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (1.597.312) | Mondelez International Inc Class A | JPMorgan Chase Bank | 67.007 | 0,00 |
| (96.692) | Mondelez International Inc Class A | Morgan Stanley | 667 | 0,00 |
| (1.144.963) | Mondelez International Inc Class A | Goldman Sachs International | 37.204 | 0,00 |
| (47.956) | MongoDB Inc | Morgan Stanley | 8.944 | 0,00 |
| (81.085) | MongoDB Inc | JPMorgan Chase Bank | 7.419 | 0,00 |
| (43.291) | Monster Beverage Corp | JPMorgan Chase Bank | 525 | 0,00 |
| (45.761) | Monster Beverage Corp | Morgan Stanley | 1.508 | 0,00 |
| 907 | Montauk Renewables Inc | Morgan Stanley | 75 | 0,00 |
| 665 | Moody's Corp | Morgan Stanley | 2.241 | 0,00 |
| 100 | MoonLake Immunotherapeutics | Morgan Stanley | 210 | 0,00 |
| (1) | Morgan Stanley | Goldman Sachs International | 1 | 0,00 |
| (36.878) | Morgan Stanley | JPMorgan Chase Bank | 6.848 | 0,00 |
| (361.329) | Morphic Holding Inc | JPMorgan Chase Bank | 119.127 | 0,01 |
| (16.804) | Morphic Holding Inc | Goldman Sachs International | 4.134 | 0,00 |
| (115.219) | Mosaic Co | Morgan Stanley | 7.447 | 0,00 |
| (108.207) | Motorola Solutions Inc | Morgan Stanley | 17.814 | 0,00 |
| (1.314.239) | MPLX LP | JPMorgan Chase Bank | 27.226 | 0,00 |
| (5.324.365) | Mr Price Group Ltd | JPMorgan Chase Bank | 39.830 | 0,00 |
| (112) | MSC Industrial Direct Co Inc Class A | Morgan Stanley | 67 | 0,00 |
| 647 | MSCI Inc | Morgan Stanley | 13.161 | 0,00 |
| 2.294.009 | Mtn Group Ltd | JPMorgan Chase Bank | 701 | 0,00 |
| (1.234) | Mueller Industries Inc | Morgan Stanley | 467 | 0,00 |
| (249) | Mueller Water Products Inc Class A | Morgan Stanley | 22 | 0,00 |
| (248.078) | Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen | Goldman Sachs International | 358 | 0,00 |
| 170.321.814 | Nagoya Railroad Co Ltd | Nomura | 0 | 0,00 |
| 2.415 | Napco Security Technologies Inc | Morgan Stanley | 1.053 | 0,00 |
| 12.671 | Nasdaq Inc | Morgan Stanley | 31.281 | 0,00 |
| 1.337 | Natera Inc | Morgan Stanley | 5.645 | 0,00 |
| 381.740 | National Fuel Gas Co | Goldman Sachs International | 14.047 | 0,00 |
| 817.361 | National Fuel Gas Co | JPMorgan Chase Bank | 77.107 | 0,01 |
| 5.326 | National Vision Holdings Inc | Morgan Stanley | 5.105 | 0,00 |
| (85.347) | Natwest Group Plc | Goldman Sachs International | 6.221 | 0,00 |
| (147.397) | Natwest Group Plc | Société Générale | 0 | 0,00 |
| (3.011) | Navient Corp | Morgan Stanley | 1.312 | 0,00 |
| (282) | NBT Bancorp Inc | Morgan Stanley | 162 | 0,00 |
| 3.900.000 | NCL Corp Ltd | Nomura | 774.205 | 0,05 |
| 7.950.000 | NCL Corp Ltd | Goldman Sachs International | 1.049.908 | 0,07 |
| 254 | NCR Atleos Corp | Morgan Stanley | 28 | 0,00 |
| 5.313.913 | Nedbank Group Ltd | Goldman Sachs International | 10.268 | 0,00 |
| 480 | Nelnet Inc Class A | Morgan Stanley | 589 | 0,00 |
| (15.088) | Neogen Corp | Morgan Stanley | 1.265 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------|------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (1.290) | NeoGenomics Inc | Morgan Stanley | 4.620 | 0,00 |
| (30.382) | NerdWallet Inc Class A | JPMorgan Chase Bank | 7.842 | 0,00 |
| 5.172 | NerdWallet Inc Class A | Morgan Stanley | 3.034 | 0,00 |
| (20.244) | NET Lease Office Properties | Morgan Stanley | 2.130 | 0,00 |
| (106.462) | NetApp Inc | Morgan Stanley | 18.264 | 0,00 |
| 705.212 | NetApp Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 728.820 | Netflix Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (127.372) | Netflix Inc | Morgan Stanley | 28.595 | 0,00 |
| 813.981 | Neurocrine Biosciences Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (41.557) | Neurocrine Biosciences Inc | Morgan Stanley | 7.609 | 0,00 |
| 254 | Nevro Corp | Morgan Stanley | 72 | 0,00 |
| (17.023) | New Ambrx Biopharma Inc | Morgan Stanley | 2.692 | 0,00 |
| (167.541) | New Ambrx Biopharma Inc | JPMorgan Chase Bank | 84.350 | 0,01 |
| (16.936) | New Ambrx Biopharma Inc | Goldman Sachs International | 8.220 | 0,00 |
| 2.533 | New Jersey Resources Corp | Morgan Stanley | 705 | 0,00 |
| (23.335) | New York Community Bancorp Inc | Morgan Stanley | 1.363 | 0,00 |
| 856 | New York Times Co Class A | Morgan Stanley | 2.402 | 0,00 |
| 232 | Newmark Group Inc Class A | Morgan Stanley | 116 | 0,00 |
| (3.114) | Newmont Corp | Morgan Stanley | 1.242 | 0,00 |
| 3.000.000 | Nexi SpA | BNP Paribas | 244.246 | 0,02 |
| 9.800.000 | Nexi SpA | Société Générale | 1.108.174 | 0,07 |
| 34.362 | Nexi SpA | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (83.955) | Nexstar Media Group Inc | Morgan Stanley | 9.651 | 0,00 |
| 4.584 | NextEra Energy Inc | Morgan Stanley | 994 | 0,00 |
| 1.007 | NEXTracker Inc Class A | Morgan Stanley | 1.549 | 0,00 |
| 25.194.036 | NIO Inc | Nomura | 1.635.648 | 0,11 |
| 2.659.404.400 | Nippon Steel Corp | Société Générale | 0 | 0,00 |
| 772 | NiSource Inc | Morgan Stanley | 188 | 0,00 |
| 12.065 | NNN REIT Inc | Morgan Stanley | 4.099 | 0,00 |
| (3.300.812) | Nordea Bank Abp | Goldman Sachs International | 18.647 | 0,00 |
| (355) | Nordic American Tankers Ltd | Morgan Stanley | 41 | 0,00 |
| (76.188) | Nordstrom Inc | Morgan Stanley | 19.124 | 0,00 |
| (6.416) | Northern Oil & Gas Inc | Morgan Stanley | 5.980 | 0,00 |
| 1.646 | Northfield Bancorp Inc | Morgan Stanley | 277 | 0,00 |
| 1.265 | Northwest Bancshares Inc | Morgan Stanley | 15 | 0,00 |
| 100 | Northwest Natural Holding Co | Morgan Stanley | 29 | 0,00 |
| (2.543) | Northwestern Energy Group Inc | Morgan Stanley | 1.404 | 0,00 |
| 309.878 | Norwegian Cruise Line Holdings Ltd | JPMorgan Chase Bank | 3.448 | 0,00 |
| 5.865.443 | Norwegian Cruise Line Holdings Ltd | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (10.567) | Norwegian Cruise Line Holdings Ltd | Morgan Stanley | 1.194 | 0,00 |
| (613.281) | NOV Inc | Goldman Sachs International | 7.343 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|-------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (28) | Novagold Resources Inc | Morgan Stanley | 3 | 0,00 |
| (301.171) | Novartis AG | JPMorgan Chase Bank | 22.658 | 0,00 |
| (167.672) | Novartis AG | Goldman Sachs International | 4.583 | 0,00 |
| (3.019.012) | Novo Nordisk A/S | JPMorgan Chase Bank | 7.457 | 0,00 |
| (737.098) | Novo Nordisk A/S | Morgan Stanley | 684 | 0,00 |
| (7.013.655) | Novo Nordisk A/S | Goldman Sachs International | 290 | 0,00 |
| 3.500 | Novocure Ltd | Morgan Stanley | 6.483 | 0,00 |
| (2.341) | NOW Inc | Morgan Stanley | 290 | 0,00 |
| (73.565) | NU Holdings Ltd Class A | JPMorgan Chase Bank | 4.719 | 0,00 |
| 51.394 | NU Holdings Ltd Class A | Goldman Sachs International | 2.797 | 0,00 |
| (46.072) | NU Holdings Ltd Class A | Morgan Stanley | 7.554 | 0,00 |
| 191.535 | Nu Skin Enterprises Inc Class A | Goldman Sachs International | 18.682 | 0,00 |
| 134.135 | Nu Skin Enterprises Inc Class A | JPMorgan Chase Bank | 10.481 | 0,00 |
| 404.914 | Nucor Corp | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (1.106) | Nucor Corp | Morgan Stanley | 2.694 | 0,00 |
| 7.257 | Nutanix Inc Class A | Morgan Stanley | 7.611 | 0,00 |
| (141.539) | Nuvalent Inc Class A | Goldman Sachs International | 60.479 | 0,01 |
| (90.505) | Nuvalent Inc Class A | Morgan Stanley | 33.987 | 0,00 |
| (25.941) | Nuvei Corp | JPMorgan Chase Bank | 18.088 | 0,00 |
| (310.303) | nVent Electric Plc | Goldman Sachs International | 43.290 | 0,00 |
| (188.198) | nVent Electric Plc | JPMorgan Chase Bank | 19.183 | 0,00 |
| (265.887) | NVIDIA Corp | Morgan Stanley | 27.186 | 0,00 |
| 897.107 | NVIDIA Corp | Goldman Sachs International | 7.511 | 0,00 |
| (5.408) | NVIDIA Corp | JPMorgan Chase Bank | 28 | 0,00 |
| 3.064.396 | Ocado Group Plc | Société Générale | 309.829 | 0,02 |
| 69.668 | Occidental Petroleum Corp | Morgan Stanley | 8.195 | 0,00 |
| (799) | Oceaneering International Inc | Morgan Stanley | 157 | 0,00 |
| 10.139.541 | Okta Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 50.933 | Olaplex Holdings Inc | Goldman Sachs International | 14.381 | 0,00 |
| (36.665) | Olaplex Holdings Inc | Morgan Stanley | 11.133 | 0,00 |
| 426.533 | Old Dominion Freight Line | JPMorgan Chase Bank | 5.626 | 0,00 |
| 5.192 | Old Republic International Corp | Morgan Stanley | 1.635 | 0,00 |
| 43.388 | Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc | Morgan Stanley | 1.150 | 0,00 |
| 7.068 | Olo Inc Class A | Morgan Stanley | 651 | 0,00 |
| (557) | Omega Healthcare Investors Inc | Morgan Stanley | 169 | 0,00 |
| (203) | Omniceil Inc | Morgan Stanley | 205 | 0,00 |
| (116.663) | Omnicom Group Inc | Morgan Stanley | 21.229 | 0,00 |
| 142.741 | OMV AG | Goldman Sachs International | 5.385 | 0,00 |
| 204.950 | On Holding AG Class A | JPMorgan Chase Bank | 10.305 | 0,00 |
| 1.013.716 | ON Semiconductor Corp | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (54) | ON Semiconductor Corp | Morgan Stanley | 85 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------|---------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 1.085 | ON24 Inc | Morgan Stanley | 292 | 0,00 |
| (616) | ONE Gas Inc | Morgan Stanley | 178 | 0,00 |
| 1.245.545 | ONEOK Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (245) | OneSpaWorld Holdings Ltd | Morgan Stanley | 84 | 0,00 |
| (66.292) | Onto Innovation Inc | Morgan Stanley | 15.246 | 0,00 |
| 7.161 | Opendoor Technologies Inc | Morgan Stanley | 2.487 | 0,00 |
| (118) | OPENLANE Inc | Morgan Stanley | 0 | 0,00 |
| (119.686) | Oracle Corp | Morgan Stanley | 3.542 | 0,00 |
| 414.719 | O'Reilly Automotive Inc | JPMorgan Chase Bank | 920 | 0,00 |
| 100 | Organon & Co | Morgan Stanley | 4 | 0,00 |
| 387.665 | Ormat Technologies Inc | Goldman Sachs International | 7.208 | 0,00 |
| 10.383.362 | Ormat Technologies Inc | Nomura | 435.549 | 0,03 |
| (749.595) | Orsted AS | Goldman Sachs International | 7.632 | 0,00 |
| 41.334 | Oscar Health Inc Class A | Morgan Stanley | 38.416 | 0,00 |
| 69.724.500 | OSG Corp | Nomura | 0 | 0,00 |
| (81.190) | Oshkosh Corp | Morgan Stanley | 13.854 | 0,00 |
| (224) | Osisko Gold Royalties Ltd | Morgan Stanley | 101 | 0,00 |
| (115.731.058) | OTP Bank Nyrt | JPMorgan Chase Bank | 49.030 | 0,01 |
| (145.764.721) | OTP Bank Nyrt | Goldman Sachs International | 79.076 | 0,01 |
| (206) | Outset Medical Inc | Morgan Stanley | 105 | 0,00 |
| 75.777 | Ovintiv Inc | Morgan Stanley | 3.812 | 0,00 |
| (57.762) | Ovintiv Inc | Goldman Sachs International | 823 | 0,00 |
| (122.599) | Owens Corning | Morgan Stanley | 17.563 | 0,00 |
| (668.261) | PACCAR Inc | Goldman Sachs International | 29.649 | 0,00 |
| (268.824) | PACCAR Inc | JPMorgan Chase Bank | 8.175 | 0,00 |
| 1.520 | PACCAR Inc | Morgan Stanley | 118 | 0,00 |
| (2.048) | Pacific Biosciences of California Inc | Morgan Stanley | 436 | 0,00 |
| 19.257 | Pacira BioSciences Inc | JPMorgan Chase Bank | 2.199 | 0,00 |
| 199.432 | Pacira BioSciences Inc | Goldman Sachs International | 3.615 | 0,00 |
| 37.804 | Pacira BioSciences Inc | Morgan Stanley | 481 | 0,00 |
| 100 | Pactiv Evergreen Inc | Morgan Stanley | 81 | 0,00 |
| (179.669) | Pagseguro Digital Ltd Class A | Goldman Sachs International | 54.170 | 0,01 |
| (4.523) | Palantir Technologies Inc Class A | Morgan Stanley | 1.600 | 0,00 |
| (61.655) | Palo Alto Networks Inc | Morgan Stanley | 17.104 | 0,00 |
| 130.174.440 | Palo Alto Networks Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 38.900.000 | Palo Alto Networks Inc | Société Générale | 23.584.410 | 1,45 |
| (2.340.145) | Pandora A/S | Goldman Sachs International | 40.150 | 0,00 |
| (3.084.025) | Pandora A/S | JPMorgan Chase Bank | 120.272 | 0,01 |
| 1.571 | Paragon 28 Inc | Morgan Stanley | 228 | 0,00 |
| (102.110) | Paramount Global Class B | Morgan Stanley | 43.024 | 0,00 |
| (582) | Paramount Group Inc | Morgan Stanley | 117 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (360) | Park Hotels & Resorts Inc | Morgan Stanley | 523 | 0,00 |
| (1.294.964) | Parker-Hannifin Corp | Goldman Sachs International | 163.664 | 0,01 |
| (827.923) | Parker-Hannifin Corp | Morgan Stanley | 56.079 | 0,01 |
| (672.132) | Parker-Hannifin Corp | JPMorgan Chase Bank | 103.842 | 0,01 |
| 2.177 | Parsons Corp | Morgan Stanley | 36 | 0,00 |
| 31.631 | Patterson Cos Inc | Goldman Sachs International | 2.177 | 0,00 |
| 1.610 | Patterson Cos Inc | Morgan Stanley | 879 | 0,00 |
| 203.929 | Paychex Inc | Goldman Sachs International | 4.677 | 0,00 |
| 1.596 | Paycom Software Inc | Morgan Stanley | 1.937 | 0,00 |
| 91.221 | Paycor HCM Inc | JPMorgan Chase Bank | 707 | 0,00 |
| 42.368 | Paycor HCM Inc | Morgan Stanley | 1.908 | 0,00 |
| (76.896) | Paylocity Holding Corp | Morgan Stanley | 4.865 | 0,00 |
| 7.768 | Paylocity Holding Corp | Goldman Sachs International | 67 | 0,00 |
| 104.100 | Paylocity Holding Corp | JPMorgan Chase Bank | 220 | 0,00 |
| (61.489) | PayPal Holdings Inc | JPMorgan Chase Bank | 3.754 | 0,00 |
| (2.156) | PBF Energy Inc Class A | Morgan Stanley | 3.924 | 0,00 |
| 905 | PDF Solutions Inc | Morgan Stanley | 583 | 0,00 |
| 22.907.376 | Peabody Energy Corp | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 373 | Pediatrix Medical Group Inc | Morgan Stanley | 91 | 0,00 |
| (66.415) | Pegasystems Inc | Morgan Stanley | 11.549 | 0,00 |
| 1.410 | Penn Entertainment Inc | Morgan Stanley | 1.025 | 0,00 |
| 63 | PennyMac Financial Services Inc | Morgan Stanley | 52 | 0,00 |
| (3.583) | PennyMac Mortgage Investment Trust | Morgan Stanley | 1.989 | 0,00 |
| (2.526) | Penske Automotive Group Inc | Morgan Stanley | 954 | 0,00 |
| 1.606 | Pentair Plc | Morgan Stanley | 1.457 | 0,00 |
| (248) | Peoples Bancorp Inc | Morgan Stanley | 68 | 0,00 |
| (341.500) | Pepkor Holdings Ltd | Morgan Stanley | 2.763 | 0,00 |
| (6.630.040) | Pepkor Holdings Ltd | JPMorgan Chase Bank | 48.731 | 0,01 |
| (56.611) | PepsiCo Inc | JPMorgan Chase Bank | 3.665 | 0,00 |
| 1.021.511 | PepsiCo Inc | Morgan Stanley | 23.186 | 0,00 |
| (80.710) | Perrigo Co Plc | Morgan Stanley | 8.579 | 0,00 |
| (28.929) | Petco Health & Wellness Co Inc | Morgan Stanley | 7.498 | 0,00 |
| 1.037.246 | PG&E Corp | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (381.758) | Phillips 66 | Goldman Sachs International | 64.215 | 0,01 |
| (89.865) | Phillips 66 | Morgan Stanley | 3.705 | 0,00 |
| (782.682) | Phillips 66 | JPMorgan Chase Bank | 97.238 | 0,01 |
| (4.460) | Phillips Edison & Co Inc | Morgan Stanley | 2.201 | 0,00 |
| 3.651 | Phreesia Inc | Morgan Stanley | 2.535 | 0,00 |
| 974 | Pinnacle West Capital Corp | Morgan Stanley | 421 | 0,00 |
| (1.187) | Pinterest Inc Class A | Morgan Stanley | 385 | 0,00 |
| 62.015 | Pioneer Natural Resources Co | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|---|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 616 | Piper Sandler Cos | Morgan Stanley | 31 | 0,00 |
| 3.055 | Planet Fitness Inc Class A | Morgan Stanley | 3.183 | 0,00 |
| (760) | Plexus Corp | Morgan Stanley | 2.174 | 0,00 |
| 1.784 | PNC Financial Services Group Inc | Morgan Stanley | 3.746 | 0,00 |
| 1.023.939 | Polaris Inc | Morgan Stanley | 122.550 | 0,01 |
| 10.837.273 | POSCO Holdings Inc | Goldman Sachs International | 93.013 | 0,01 |
| 4.800.000 | Poseidon Finance 1 Ltd | Nomura | 118.818 | 0,01 |
| (466.797) | Post Holdings Inc | Goldman Sachs International | 32.579 | 0,00 |
| (583.614) | Post Holdings Inc | JPMorgan Chase Bank | 37.994 | 0,00 |
| 4.708.248 | Postal Savings Bank of China Co Ltd | Nomura | 0 | 0,00 |
| (3.256) | PotlatchDeltic Corp | Morgan Stanley | 983 | 0,00 |
| (500) | Power Integrations Inc | Morgan Stanley | 336 | 0,00 |
| (1.352.024) | Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA | Goldman Sachs International | 55.647 | 0,01 |
| (275.434) | Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA | Morgan Stanley | 3.103 | 0,00 |
| (1.918.192) | Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA | JPMorgan Chase Bank | 85.893 | 0,01 |
| (1.098.474) | Powszechny Zaklad Ubezpieczen SA | JPMorgan Chase Bank | 43.484 | 0,00 |
| 4.097 | PPG Industries Inc | Morgan Stanley | 7.812 | 0,00 |
| 3.068 | PPL Corp | Morgan Stanley | 222 | 0,00 |
| 262 | PRA Group Inc | Morgan Stanley | 202 | 0,00 |
| (85.567) | Premier Inc Class A | Morgan Stanley | 7.968 | 0,00 |
| 8.479 | Primerica Inc | Morgan Stanley | 83 | 0,00 |
| (3.338) | Primo Water Corp | Morgan Stanley | 576 | 0,00 |
| (115.120) | Principal Financial Group Inc | Morgan Stanley | 18.472 | 0,00 |
| (1.758) | ProAssurance Corp | Morgan Stanley | 150 | 0,00 |
| 2.555 | Procore Technologies Inc | Morgan Stanley | 3.911 | 0,00 |
| (170.340) | Procter & Gamble Co | JPMorgan Chase Bank | 2.853 | 0,00 |
| 74.482 | Procter & Gamble Co | Morgan Stanley | 2.294 | 0,00 |
| 2.359 | Progressive Corp | Morgan Stanley | 5.852 | 0,00 |
| (270) | Progyny Inc | Morgan Stanley | 83 | 0,00 |
| (104.660) | Prosus NV | Morgan Stanley | 3.022 | 0,00 |
| 114.806 | Prosus NV | JPMorgan Chase Bank | 8.157 | 0,00 |
| (318.639) | Prosus NV | Goldman Sachs International | 21.487 | 0,00 |
| (122.305) | Prudential Financial Inc | Morgan Stanley | 14.094 | 0,00 |
| 242.293 | Prudential Financial Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (1.920.768) | Prudential Plc | Morgan Stanley | 0 | 0,00 |
| (275.925) | PTC Therapeutics Inc | Goldman Sachs International | 47.044 | 0,01 |
| (366.516) | PTC Therapeutics Inc | JPMorgan Chase Bank | 59.321 | 0,01 |
| 4.370 | PTC Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 541 | 0,00 |
| (40) | Public Storage | Morgan Stanley | 44 | 0,00 |
| (213.070) | PulteGroup Inc | Morgan Stanley | 1.352 | 0,00 |
| (744.271) | PulteGroup Inc | JPMorgan Chase Bank | 2.549 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|--------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (135) | Pure Storage Inc Class A | Morgan Stanley | 30 | 0,00 |
| (296.583) | PVH Corp | Goldman Sachs International | 79.979 | 0,01 |
| (1.503.443) | PVH Corp | JPMorgan Chase Bank | 526.528 | 0,03 |
| 1.221.125 | Qorvo Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (201.515) | Qorvo Inc | Morgan Stanley | 31.638 | 0,00 |
| (126.840) | QUALCOMM Inc | Morgan Stanley | 16.502 | 0,00 |
| (192.293) | Quanta Services Inc | Goldman Sachs International | 48.713 | 0,01 |
| (1.785) | QuantumScape Corp | Morgan Stanley | 578 | 0,00 |
| (929.528) | Quest Diagnostics Inc | Goldman Sachs International | 45.990 | 0,01 |
| (84.706) | QuidelOrtho Corp | Morgan Stanley | 4.207 | 0,00 |
| 50.669 | R1 RCM Inc | Morgan Stanley | 12.695 | 0,00 |
| (2.892) | Radian Group Inc | Morgan Stanley | 10 | 0,00 |
| 1.616.871 | Ralph Lauren Corp | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 1.169 | Rambus Inc | Morgan Stanley | 1.857 | 0,00 |
| 44.252 | Range Resources Corp | Morgan Stanley | 5.186 | 0,00 |
| 277.307 | Range Resources Corp | Goldman Sachs International | 30.747 | 0,00 |
| 316.168 | Range Resources Corp | JPMorgan Chase Bank | 35.575 | 0,00 |
| (55) | Raymond James Financial Inc | Morgan Stanley | 87 | 0,00 |
| 2.882 | RE/MAX Holdings Inc Class A | Morgan Stanley | 1.580 | 0,00 |
| (6.450) | Ready Capital Corp | Morgan Stanley | 4.070 | 0,00 |
| 5.578 | Redfin Corp | Morgan Stanley | 4.022 | 0,00 |
| (533.427) | Regeneron Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs International | 9.615 | 0,00 |
| (334.633) | Regeneron Pharmaceuticals Inc | JPMorgan Chase Bank | 16.283 | 0,00 |
| (42.044) | Regeneron Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 3.575 | 0,00 |
| (76.259) | Reinsurance Group of America Class A | Morgan Stanley | 9.598 | 0,00 |
| (2.462) | Remitly Global Inc | Morgan Stanley | 3.860 | 0,00 |
| (25.405) | Remitly Global Inc | JPMorgan Chase Bank | 678 | 0,00 |
| (1.534) | Repligen Corp | Morgan Stanley | 3.291 | 0,00 |
| 813 | REV Group Inc | Morgan Stanley | 130 | 0,00 |
| 17.079 | Revance Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 12.568 | 0,00 |
| 16.302 | Revance Therapeutics Inc | Goldman Sachs International | 10.786 | 0,00 |
| (100.123) | REVOLUTION Medicines Inc | Goldman Sachs International | 40.380 | 0,00 |
| (189.842) | REVOLUTION Medicines Inc | JPMorgan Chase Bank | 91.663 | 0,01 |
| (703) | Revolve Group Inc | Morgan Stanley | 1.074 | 0,00 |
| 2.654 | Rexford Industrial Realty Inc | Morgan Stanley | 602 | 0,00 |
| 338.935 | Reynolds Consumer Products Inc | JPMorgan Chase Bank | 20.095 | 0,00 |
| 566 | Reynolds Consumer Products Inc | Morgan Stanley | 130 | 0,00 |
| (72.617) | RH | Morgan Stanley | 18.303 | 0,00 |
| 934.474 | RH | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 41.902.746 | Rheinmetall AG | Société Générale | 4.940.082 | 0,31 |
| 44.713 | Rhythm Pharmaceuticals Inc | JPMorgan Chase Bank | 1.317 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|-------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 2.889 | RingCentral Inc Class A | Morgan Stanley | 911 | 0,00 |
| (408.309) | Rio Tinto Plc | Goldman Sachs International | 61.982 | 0,01 |
| (9.326) | Rio Tinto Plc | Morgan Stanley | 77 | 0,00 |
| (32.111) | Rio Tinto Plc | JPMorgan Chase Bank | 432 | 0,00 |
| (17.388) | Riot Platforms Inc | Morgan Stanley | 25.880 | 0,00 |
| (68.964) | Rithm Capital Corp | Morgan Stanley | 11.738 | 0,00 |
| 4.636.216 | Rivian Automotive Inc Class A | Nomura | 0 | 0,00 |
| (8.480) | Rivian Automotive Inc Class A | Morgan Stanley | 2.434 | 0,00 |
| 5.000.000 | Rivian Automotive Inc | Nomura | 1.491.895 | 0,09 |
| (404) | RLJ Lodging Trust | Morgan Stanley | 94 | 0,00 |
| (113.041) | Robert Half International Inc | Morgan Stanley | 25.249 | 0,00 |
| 1.371.041 | Roche Holding AG | Goldman Sachs International | 113.282 | 0,02 |
| (855) | Rocket Cos Inc Class A | Morgan Stanley | 257 | 0,00 |
| (122.810) | Rockwell Automation Inc | Goldman Sachs International | 15.837 | 0,00 |
| (169.286) | Rockwell Automation Inc | JPMorgan Chase Bank | 24.139 | 0,00 |
| (21.874) | Rogers Communications Inc | JPMorgan Chase Bank | 259 | 0,00 |
| (52.119) | Rogers Communications Inc | Morgan Stanley | 2.083 | 0,00 |
| (157.413) | Rogers Communications Inc | Goldman Sachs International | 22.898 | 0,00 |
| (211) | Rogers Corp | Morgan Stanley | 544 | 0,00 |
| 2.508 | Roku Inc | Morgan Stanley | 2.203 | 0,00 |
| (121.298) | Rollins Inc | Morgan Stanley | 15.070 | 0,00 |
| (72) | Roper Technologies Inc | Morgan Stanley | 10 | 0,00 |
| (1.077.960) | Ross Stores Inc | JPMorgan Chase Bank | 27.343 | 0,00 |
| 2.209 | Royal Bank of Canada | Morgan Stanley | 1.742 | 0,00 |
| (1.031.187) | Royal Caribbean Cruises Ltd | JPMorgan Chase Bank | 312.690 | 0,02 |
| 1.338 | Royal Caribbean Cruises Ltd | Morgan Stanley | 8.633 | 0,00 |
| 163.556 | Royalty Pharma Plc Class A | Goldman Sachs International | 23.852 | 0,00 |
| 2.062 | Royalty Pharma Plc Class A | Morgan Stanley | 1.500 | 0,00 |
| 75.853 | RPC Inc | Goldman Sachs International | 4.612 | 0,00 |
| (6.217) | RPC Inc | Morgan Stanley | 798 | 0,00 |
| 273.717 | RPC Inc | JPMorgan Chase Bank | 49.282 | 0,01 |
| 3.394 | RTX Corp | Morgan Stanley | 5.252 | 0,00 |
| (258.758) | RWE AA | Goldman Sachs International | 28.452 | 0,00 |
| (474) | RXO Inc | Morgan Stanley | 275 | 0,00 |
| 1.156 | RxSight Inc | Morgan Stanley | 2.135 | 0,00 |
| 1.140 | Ryan Specialty Holdings Inc | Morgan Stanley | 98 | 0,00 |
| (703.288) | Ryanair Holdings Plc | JPMorgan Chase Bank | 98.367 | 0,01 |
| (82.319) | Ryder System Inc | Morgan Stanley | 8.473 | 0,00 |
| (668.180) | SABESP ON | Goldman Sachs International | 32.282 | 0,00 |
| (443) | Sabra Health Care REIT Inc | Morgan Stanley | 86 | 0,00 |
| 34.641 | Sabre Corp | Morgan Stanley | 3.338 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------|---|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 318.856 | Saipem SpA | Société Générale | 0 | 0,00 |
| 2.500.000 | Saipem SpA | Nomura | 105.741 | 0,01 |
| (135.082) | Salesforce Inc | Morgan Stanley | 7.597 | 0,00 |
| 20.818 | Samsara Inc Class A | JPMorgan Chase Bank | 678 | 0,00 |
| 25.064 | Samsara Inc Class A | Goldman Sachs International | 487 | 0,00 |
| 468 | Sandy Spring Bancorp Inc | Morgan Stanley | 292 | 0,00 |
| (4.123.245) | Sanlam Ltd | Morgan Stanley | 16.526 | 0,00 |
| (2.769.104) | Sanlam Ltd | JPMorgan Chase Bank | 19.121 | 0,00 |
| (2.188.619) | Sanlam Ltd | Goldman Sachs International | 1.091 | 0,00 |
| (3.516) | Sanmina Corp | Morgan Stanley | 4.079 | 0,00 |
| (1.090.396) | Santander Bank Polska SA | Goldman Sachs International | 30.484 | 0,00 |
| 54.155 | Sarepta Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 6.440 | 0,00 |
| 15.161.441 | Sarepta Therapeutics Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (472.590) | Sartorius AG-Vorzug | JPMorgan Chase Bank | 108.032 | 0,01 |
| (10.961) | Sartorius AG-Vorzug | Goldman Sachs International | 735 | 0,00 |
| 5.623.144 | Sasol Ltd | JPMorgan Chase Bank | 60.610 | 0,01 |
| 3.419.296 | Sasol Ltd | Goldman Sachs International | 13.317 | 0,00 |
| (8.449) | SBA Communications Corp | JPMorgan Chase Bank | 143 | 0,00 |
| (24.309) | SBA Communications Corp | Goldman Sachs International | 4.498 | 0,00 |
| (65.055) | SBA Communications Corp | Morgan Stanley | 3.956 | 0,00 |
| 750.000.000 | SBI Holdings Inc | Nomura | 348.854 | 0,02 |
| 3.490.963.413 | SBI Holdings Inc | Société Générale | 0 | 0,00 |
| (13.498) | Schlumberger NV | Morgan Stanley | 13.366 | 0,00 |
| 47.507 | Schneider National Inc Class B | Morgan Stanley | 2.226 | 0,00 |
| (84.510) | Science Applications International Corp | Morgan Stanley | 6.220 | 0,00 |
| (54) | Scientific Games Corp Class A | Morgan Stanley | 5 | 0,00 |
| (408) | Scorpio Tankers Inc | Morgan Stanley | 638 | 0,00 |
| 27.750.000 | Seagate HDD Cayman | Nomura | 5.198.688 | 0,32 |
| 19.257.199 | Seagate Technology Holdings Plc | Nomura | 0 | 0,00 |
| (116.752) | Sealed Air Corp | Morgan Stanley | 17.871 | 0,00 |
| (101) | SEI Investments Co | Morgan Stanley | 4 | 0,00 |
| (1.317) | Select Medical Holdings Corp | Morgan Stanley | 1.067 | 0,00 |
| 14.157 | Sempra | Morgan Stanley | 13.531 | 0,00 |
| (27.915) | Semtech Corp | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (133.717) | Sensata Technologies Holding | Morgan Stanley | 10.698 | 0,00 |
| (456) | Sensient Technologies Corp | Morgan Stanley | 72 | 0,00 |
| 1.678 | SentinelOne Inc Class A | Morgan Stanley | 832 | 0,00 |
| 1.765 | Service Corp International | Morgan Stanley | 207 | 0,00 |
| (223.631) | ServiceNow Inc | Morgan Stanley | 46.571 | 0,00 |
| 2.917.465 | ServiceNow Inc | Goldman Sachs International | 17.196 | 0,00 |
| (65.144) | ServiceNow Inc | JPMorgan Chase Bank | 12.460 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|-------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 160.812 | Severn Trent Plc | Goldman Sachs International | 1.169 | 0,00 |
| (1.924) | SFL Corp Ltd | Morgan Stanley | 332 | 0,00 |
| 866 | Shake Shack Inc Class A | Morgan Stanley | 90 | 0,00 |
| (330.857) | Sharkninja Inc | JPMorgan Chase Bank | 59.416 | 0,01 |
| (565.715) | Sharkninja Inc | Morgan Stanley | 88.401 | 0,01 |
| (93.161) | Sharkninja Inc | Goldman Sachs International | 9.487 | 0,00 |
| 1.587.455 | Sherwin-Williams Co | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (116.626) | Sherwin-Williams Co | Morgan Stanley | 28.564 | 0,00 |
| (4.145.837) | Shift4 Payments Inc Class A | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (231.858) | Shockwave Medical Inc | Goldman Sachs International | 16.845 | 0,00 |
| (10.704) | Shopify Inc Class A | Goldman Sachs International | 4.214 | 0,00 |
| (117.879) | Shopify Inc Class A | JPMorgan Chase Bank | 12.928 | 0,00 |
| (19.876) | Shopify Inc Class A | Morgan Stanley | 1.009 | 0,00 |
| 178 | SI-BONE Inc | Morgan Stanley | 36 | 0,00 |
| 49.705.436 | Siemens Energy AG | Société Générale | 0 | 0,00 |
| 77.200.000 | Siemens Energy Finance BV | Société Générale | 1.226.294 | 0,08 |
| (188) | SIGA Technologies Inc | Morgan Stanley | 15 | 0,00 |
| (416.591) | Signet Jewelers Ltd | JPMorgan Chase Bank | 182.078 | 0,01 |
| (1.149.647) | Signet Jewelers Ltd | Morgan Stanley | 471.456 | 0,03 |
| 672.097 | Signet Jewelers Ltd | Goldman Sachs International | 2.234 | 0,00 |
| 1.279 | Silk Road Medical Inc | Morgan Stanley | 2.727 | 0,00 |
| (1.527) | SilverCrest Metals Inc | Morgan Stanley | 81 | 0,00 |
| (1.617) | Simmons First National Corp Class A | Morgan Stanley | 217 | 0,00 |
| 5.800.000 | Simon Global Development BV | Société Générale | 535.304 | 0,04 |
| 917.261 | Simon Property Group Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (108.346) | Simon Property Group Inc | Morgan Stanley | 39.668 | 0,00 |
| (54.667) | Simply Good Foods Co | JPMorgan Chase Bank | 338 | 0,00 |
| (47.883) | Simply Good Foods Co | Morgan Stanley | 676 | 0,00 |
| 43.890 | Sirius XM Holdings Inc | Morgan Stanley | 7.391 | 0,00 |
| 25.145.300 | SK Hynix Inc | Goldman Sachs International | 167.377 | 0,01 |
| 13.800.000 | SK Hynix Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.141.050 | 0,07 |
| (83.985) | Skechers USA Inc Class A | Morgan Stanley | 5.264 | 0,00 |
| (1.085.160) | Skechers USA Inc Class A | JPMorgan Chase Bank | 219.541 | 0,02 |
| 901.030 | Skechers USA Inc Class A | Goldman Sachs International | 50.674 | 0,01 |
| (78) | Skechers USA Inc | Morgan Stanley | 14 | 0,00 |
| 182 | SkyWest Inc | Morgan Stanley | 231 | 0,00 |
| (180.389) | Skyworks Solutions Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (1.412) | SL Green Realty Corp | Morgan Stanley | 1.988 | 0,00 |
| (72.238) | SLM Corp | Morgan Stanley | 33.508 | 0,00 |
| (171.039) | SM Energy Co | JPMorgan Chase Bank | 10.733 | 0,00 |
| (86.439) | SM Energy Co | Goldman Sachs International | 3.561 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|---|-------------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (989) | SM Energy Co | Morgan Stanley | 428 | 0,00 |
| 5.236 | SMART Global Holdings Inc | Morgan Stanley | 2.912 | 0,00 |
| (72.725) | Smartsheet Inc Class A | Morgan Stanley | 18.849 | 0,00 |
| 4.600.000 | Snam SpA | Société Générale | 403.206 | 0,03 |
| (351.483) | Societe Generale SA | Goldman Sachs International | 40.918 | 0,00 |
| (1.236) | SolarEdge Technologies Inc | Morgan Stanley | 5.368 | 0,00 |
| 1.639 | SolarWinds Corp | Morgan Stanley | 1.370 | 0,00 |
| (769) | Sonos Inc | Morgan Stanley | 45 | 0,00 |
| (2.611) | South State Corp | Morgan Stanley | 2.226 | 0,00 |
| (13) | Southern Copper Corp | Morgan Stanley | 23 | 0,00 |
| (17.347) | Southwest Airlines Co | Morgan Stanley | 7.877 | 0,00 |
| (67.047) | Southwestern Energy Co | Morgan Stanley | 5.297 | 0,00 |
| 226.168 | Sovos Brands Inc | JPMorgan Chase Bank | 1.715 | 0,00 |
| 287.609 | Sovos Brands Inc | Goldman Sachs International | 4.356 | 0,00 |
| (171.023) | Spectrum Brands Holdings Inc | Morgan Stanley | 26.288 | 0,00 |
| (67.774) | Spectrum Brands Holdings Inc | JPMorgan Chase Bank | 5.797 | 0,00 |
| (1.508.971) | Spectrum Brands Holdings Inc | Goldman Sachs International | 223.339 | 0,02 |
| (25.337) | Sphere Entertainment Co | JPMorgan Chase Bank | 4.492 | 0,00 |
| (33.552) | Sphere Entertainment Co | Goldman Sachs International | 2.836 | 0,00 |
| (5.796) | Sphere Entertainment Co | Morgan Stanley | 4.326 | 0,00 |
| 1.193 | Spirit AeroSystems Holdings Inc Class A | Morgan Stanley | 393 | 0,00 |
| 953 | Spotify Technology SA | JPMorgan Chase Bank | 19 | 0,00 |
| 24.995 | SpringBig Holdings Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 5.057 | Sprinklr Inc Class A | Morgan Stanley | 1.232 | 0,00 |
| (405) | Sprouts Farmers Market Inc | Morgan Stanley | 29 | 0,00 |
| 220 | SPX Technologies Inc | Morgan Stanley | 294 | 0,00 |
| 3.874 | Squarespace Inc Class A | Morgan Stanley | 12.884 | 0,00 |
| (515) | SS&C Technologies Holdings Inc | Morgan Stanley | 64 | 0,00 |
| (338.762) | SSE Plc | Goldman Sachs International | 48.539 | 0,01 |
| (20) | Stagwell Inc | Morgan Stanley | 1 | 0,00 |
| (4.474.949) | Standard Bank Group Ltd | Goldman Sachs International | 29.833 | 0,00 |
| (8.163.711) | Standard Bank Group Ltd | JPMorgan Chase Bank | 63.031 | 0,01 |
| 232.414 | Starbucks Corp | Goldman Sachs International | 3.820 | 0,00 |
| 1.035 | Starbucks Corp | Morgan Stanley | 795 | 0,00 |
| 403.867 | Starbucks Corp | JPMorgan Chase Bank | 11.475 | 0,00 |
| 78.679 | Stem Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (116) | Stericycle Inc | Morgan Stanley | 46 | 0,00 |
| (3.359) | Steven Madden Ltd | Morgan Stanley | 4.064 | 0,00 |
| (621) | Stifel Financial Corp | Morgan Stanley | 320 | 0,00 |
| 3.200.000 | Stillwater Mining Co | Bank of America Merrill Lynch | 648.000 | 0,04 |
| 59.374 | STMicroelectronics NV | Morgan Stanley | 1.400 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|---|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 50.648 | Stoneco Ltd Class A | Goldman Sachs International | 1.346 | 0,00 |
| 465 | Stoneridge Inc | Morgan Stanley | 152 | 0,00 |
| 323 | Stryker Corp | Morgan Stanley | 2.330 | 0,00 |
| (2.006) | Suncor Energy Inc | Morgan Stanley | 790 | 0,00 |
| 1.305.115 | Sunnova Energy International Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (544) | Sunstone Hotel Investors Inc | Morgan Stanley | 32 | 0,00 |
| (306) | Super Micro Computer Inc | Morgan Stanley | 7.075 | 0,00 |
| 100 | Supernus Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 115 | 0,00 |
| (349.445) | Surgery Partners Inc | Goldman Sachs International | 28.354 | 0,00 |
| (1.578) | Surgery Partners Inc | Morgan Stanley | 1.004 | 0,00 |
| (2.182.103) | Svenska Handelsbanken | Goldman Sachs International | 25.958 | 0,00 |
| (654.259) | Swedish Orphan Biovitrum AB | Morgan Stanley | 670 | 0,00 |
| (5.549.808) | Swedish Orphan Biovitrum AB | JPMorgan Chase Bank | 74.160 | 0,00 |
| (2.543.468) | Swedish Orphan Biovitrum AB | Goldman Sachs International | 22.673 | 0,00 |
| 3.052.619 | Swiss Prime Site AG | Société Générale | 0 | 0,00 |
| 12.803.586 | Swiss Re AG | Goldman Sachs International | 8.107 | 0,00 |
| 8.848.804 | Swiss Re AG | Société Générale | 38.622 | 0,00 |
| (443) | Sylvamo Corp | Morgan Stanley | 546 | 0,00 |
| (117.058) | Synchrony Financial | Morgan Stanley | 33.761 | 0,00 |
| 74.446 | Synopsys Inc | Morgan Stanley | 5.069 | 0,00 |
| (70.848) | Synovus Financial Corp | Morgan Stanley | 30.673 | 0,00 |
| (115.098) | Sysco Corp | Morgan Stanley | 14.231 | 0,00 |
| 17.026 | Sysco Corp | Goldman Sachs International | 76 | 0,00 |
| (237.705) | T Rowe Price Group Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 2.943 | Tactile Systems Technology Inc | Morgan Stanley | 1.177 | 0,00 |
| (112.858) | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | Morgan Stanley | 8.682 | 0,00 |
| 646.086.540 | Taiyo Yuden Co Ltd | Nomura | 0 | 0,00 |
| (121.341) | Take-Two Interactive Software Inc | Morgan Stanley | 15.896 | 0,00 |
| 2.165.243 | Take-Two Interactive Software Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (630) | Talos Energy Inc | Morgan Stanley | 101 | 0,00 |
| (270.115) | Tandem Diabetes Care Inc | Goldman Sachs International | 62.814 | 0,01 |
| 1.292.286 | Tanger Factory Outlet Centers Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (2.945) | Tango Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 113 | 0,00 |
| (664.263) | Tapestry Inc | Morgan Stanley | 164.739 | 0,01 |
| (460.946) | Targa Resources Corp | JPMorgan Chase Bank | 18.208 | 0,00 |
| 1.063.592 | Targa Resources Corp | Goldman Sachs International | 126.493 | 0,01 |
| (967.693) | Target Corp | Morgan Stanley | 305.044 | 0,02 |
| (845.163) | Target Corp | JPMorgan Chase Bank | 27.398 | 0,00 |
| (97) | Tarsus Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 2 | 0,00 |
| 100 | TaskUS Inc Class A | Morgan Stanley | 79 | 0,00 |
| (1.534) | TC Energy Corp | Morgan Stanley | 1.106 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|--------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 384.755 | TD SYNEX Corp | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (78.014) | TD SYNEX Corp | Morgan Stanley | 14.524 | 0,00 |
| 2.262 | TE Connectivity Ltd | Morgan Stanley | 564 | 0,00 |
| 573 | TechTarget Inc | Morgan Stanley | 254 | 0,00 |
| (414) | Teekay Tankers Ltd Class A | Morgan Stanley | 966 | 0,00 |
| (410.643) | Teleflex Inc | Goldman Sachs International | 41.585 | 0,00 |
| (145.473) | Temple & Webster Group Ltd | JPMorgan Chase Bank | 30.265 | 0,00 |
| (1.630.935) | Tempur Sealy International Inc | JPMorgan Chase Bank | 312.698 | 0,02 |
| 1.912 | Tempur Sealy International Inc | Morgan Stanley | 2.331 | 0,00 |
| 330 | Tenable Holdings Inc | Morgan Stanley | 155 | 0,00 |
| 1.293.865 | Tencent Holdings Ltd | Goldman Sachs International | 23.306 | 0,00 |
| 689.715 | Tenet Healthcare Corp | Goldman Sachs International | 24.998 | 0,00 |
| (63) | Tenet Healthcare Corp | Morgan Stanley | 65 | 0,00 |
| (409) | Terex Corp | Morgan Stanley | 360 | 0,00 |
| 197.242 | Tesla Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 1.076.056 | Tetra Tech Inc | Nomura | 0 | 0,00 |
| 70.665 | Texas Instruments Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 4.472 | Texas Roadhouse Inc | Morgan Stanley | 13.381 | 0,00 |
| (4.262) | TFS Financial Corp | Morgan Stanley | 996 | 0,00 |
| 572.180 | Thor Industries Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (35) | Tidewater Inc | Morgan Stanley | 121 | 0,00 |
| (37) | TimkenSteel Corp | Morgan Stanley | 5 | 0,00 |
| (64.724) | TKO Group Holdings Inc | JPMorgan Chase Bank | 2.963 | 0,00 |
| (5.997) | TKO Group Holdings Inc | Morgan Stanley | 127 | 0,00 |
| (58.731) | TKO Group Holdings Inc Class A | Goldman Sachs International | 335 | 0,00 |
| (423.572) | T-Mobile US Inc | Morgan Stanley | 72.263 | 0,01 |
| (5.547.871) | T-Mobile US Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (19.508) | Toast Inc Class A | Goldman Sachs International | 5.691 | 0,00 |
| (55.487) | Toast Inc Class A | JPMorgan Chase Bank | 15.987 | 0,00 |
| 311.971.880 | Tokyu Corp | Société Générale | 0 | 0,00 |
| (1.530.930) | Toll Brothers Inc | Goldman Sachs International | 104.938 | 0,01 |
| (177.251) | Toll Brothers Inc | Morgan Stanley | 30.095 | 0,00 |
| (514.100) | Tractor Supply Co | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 206.495.168 | Transcosmos Inc | Nomura | 0 | 0,00 |
| 435 | TransDigm Group Inc | Morgan Stanley | 10.176 | 0,00 |
| 13.543 | Transocean Ltd | Morgan Stanley | 212 | 0,00 |
| (3.893) | TransUnion | Morgan Stanley | 3.409 | 0,00 |
| (93.806) | TransUnion | JPMorgan Chase Bank | 1.868 | 0,00 |
| (460.795) | Travel + Leisure Co | Morgan Stanley | 34.718 | 0,00 |
| 1.432 | Travelers Cos Inc | Morgan Stanley | 3.667 | 0,00 |
| 37 | Travere Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 15 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------|-----------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (67.695) | TreeHouse Foods Inc | JPMorgan Chase Bank | 4.508 | 0,00 |
| 1.337 | Trex Co Inc | Morgan Stanley | 182 | 0,00 |
| (3.399) | Tri Pointe Homes Inc | Morgan Stanley | 359 | 0,00 |
| 829 | Tricon Residential Inc | Morgan Stanley | 11 | 0,00 |
| (472) | Trimble Inc | Morgan Stanley | 36 | 0,00 |
| 5.447 | TriNet Group Inc | Goldman Sachs International | 140 | 0,00 |
| (157) | TriNet Group Inc | Morgan Stanley | 317 | 0,00 |
| 306 | Tritium DCFC Ltd | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 1.490 | Trustmark Corp | Morgan Stanley | 208 | 0,00 |
| (4.601.448) | Truworths International Ltd | JPMorgan Chase Bank | 29.979 | 0,00 |
| 1.200.000 | TUI AG | UBS AG | 324.184 | 0,02 |
| (4.118) | Twilio Inc Class A | Morgan Stanley | 558 | 0,00 |
| 533 | Twist Bioscience Corp | Morgan Stanley | 112 | 0,00 |
| (196.769) | Uber Technologies Inc | Goldman Sachs International | 29.763 | 0,00 |
| (200.802) | Uber Technologies Inc | Morgan Stanley | 73.438 | 0,01 |
| 17.500.000 | Uber Technologies Inc | Goldman Sachs International | 2.155.212 | 0,13 |
| (17.500.000) | Uber Technologies Inc | Goldman Sachs International | 600.471 | 0,04 |
| (1.728.493) | Ubisoft Entertainment SA | Société Générale | 0 | 0,00 |
| 53.417 | UCB SA | Morgan Stanley | 1.697 | 0,00 |
| 6.800 | UDR Inc | Morgan Stanley | 5.445 | 0,00 |
| 5.878 | UGI Corp | Morgan Stanley | 9.247 | 0,00 |
| (3.616) | UiPath Inc Class A | Morgan Stanley | 1.129 | 0,00 |
| (94.375) | Ultra Beauty Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 672 | Ultra Beauty Inc | Morgan Stanley | 5.083 | 0,00 |
| (247.696) | Ultragenyx Pharmaceutical Inc | Morgan Stanley | 87.395 | 0,01 |
| (227.446) | Ultragenyx Pharmaceutical Inc | Goldman Sachs International | 59.513 | 0,01 |
| 10.355 | UMH Properties Inc | Morgan Stanley | 1.400 | 0,00 |
| (1.277) | Under Armour Inc Class A | Morgan Stanley | 577 | 0,00 |
| (353.189) | UniCredit SpA | Goldman Sachs International | 28.820 | 0,00 |
| 4.400.000 | UniCredit SpA | Société Générale | 49.414 | 0,01 |
| 111.983 | Unilever Plc | JPMorgan Chase Bank | 3.564 | 0,00 |
| 559.173 | Unilever Plc | Goldman Sachs International | 19.517 | 0,00 |
| (817.173) | Union Pacific Corp | Goldman Sachs International | 36.307 | 0,00 |
| (1.171.099) | Union Pacific Corp | JPMorgan Chase Bank | 148.137 | 0,02 |
| (648.601) | Union Pacific Corp | Morgan Stanley | 58.848 | 0,01 |
| 209.690 | United Airlines Holdings Inc | Goldman Sachs International | 5.732 | 0,00 |
| (82.816) | United Airlines Holdings Inc | Morgan Stanley | 4.065 | 0,00 |
| 690.257 | United Parcel Service Inc Class B | JPMorgan Chase Bank | 5.813 | 0,00 |
| 150.837 | United Rentals Inc | Goldman Sachs International | 290 | 0,00 |
| 1.560.728 | United States Steel Corp | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 107.683 | United Utilities Group Plc | Goldman Sachs International | 6.028 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|---------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 103 | UnitedHealth Group Inc | Morgan Stanley | 24 | 0,00 |
| 395.360 | Universal Display Corp | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 1.290 | Universal Health Services Inc Class B | Morgan Stanley | 3.770 | 0,00 |
| 11.596 | Unum Group | Morgan Stanley | 6.841 | 0,00 |
| 976 | US Foods Holding Corp | Morgan Stanley | 197 | 0,00 |
| (78.609) | Utz Brands Inc | Goldman Sachs International | 12.069 | 0,00 |
| (124.813) | Utz Brands Inc | JPMorgan Chase Bank | 20.272 | 0,00 |
| (7.840) | Utz Brands Inc | Morgan Stanley | 1.685 | 0,00 |
| (59.084) | UWM Holdings Corp | Morgan Stanley | 35.607 | 0,00 |
| (4.524) | VAALCO Energy Inc | Morgan Stanley | 914 | 0,00 |
| 545.025 | Valero Energy Corp | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (234) | Valero Energy Corp | Morgan Stanley | 242 | 0,00 |
| (1.851.070) | Valvoline Inc | Morgan Stanley | 140.931 | 0,01 |
| (36.383) | Vaxcyte Inc | Goldman Sachs International | 11.265 | 0,00 |
| (8.278) | Vaxcyte Inc | Morgan Stanley | 2.908 | 0,00 |
| (9.131) | Vaxcyte Inc | JPMorgan Chase Bank | 2.611 | 0,00 |
| 162 | Veeva Systems Inc Class A | Morgan Stanley | 916 | 0,00 |
| 1.463 | Ventas Inc | Morgan Stanley | 457 | 0,00 |
| 5.044 | Veradigm Inc | Morgan Stanley | 3.127 | 0,00 |
| (73.862) | Veralto Corp | Morgan Stanley | 7.886 | 0,00 |
| 1.874 | Veralto Corp | Morgan Stanley | 170 | 0,00 |
| 2.329 | Vericel Corp | Morgan Stanley | 2.066 | 0,00 |
| 3.714 | Veris Residential Inc | Morgan Stanley | 289 | 0,00 |
| 182.091 | VeriSign Inc | JPMorgan Chase Bank | 5.620 | 0,00 |
| 346.056 | VeriSign Inc | Goldman Sachs International | 2.953 | 0,00 |
| (120.742) | VeriSign Inc | Morgan Stanley | 3.046 | 0,00 |
| (140.880) | Verisk Analytics Inc | Morgan Stanley | 2.073 | 0,00 |
| (215.521) | Verisk Analytics Inc | JPMorgan Chase Bank | 4.262 | 0,00 |
| 1.626 | Verizon Communications Inc | Morgan Stanley | 219 | 0,00 |
| 133.668 | Vertex Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs International | 130 | 0,00 |
| 461 | Vertex Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 2.026 | 0,00 |
| (55.818) | Vertiv Holdings Co Class A | JPMorgan Chase Bank | 148 | 0,00 |
| (49.994) | Vertiv Holdings Co Class A | Morgan Stanley | 469 | 0,00 |
| (189.276) | Vertiv Holdings Co Class A | Goldman Sachs International | 7.074 | 0,00 |
| (208) | Verve Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 16 | 0,00 |
| 1.738 | Vestis Corp | Morgan Stanley | 375 | 0,00 |
| (113.098) | Vici Properties Inc | Morgan Stanley | 20.890 | 0,00 |
| 13.704.889 | Virgin Galactic Holdings Inc | Nomura | 942.274 | 0,06 |
| (423.954) | Viridian Therapeutics Inc | JPMorgan Chase Bank | 83.847 | 0,01 |
| (82.823) | Virtu Financial Inc Class A | Morgan Stanley | 9.144 | 0,00 |
| 16.470.455 | Vishay Intertechnology Inc | Nomura | 641.308 | 0,04 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|---------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (6.254) | Vishay Intertechnology Inc | Morgan Stanley | 15 | 0,00 |
| (3.273) | Vista Outdoor Inc | Morgan Stanley | 941 | 0,00 |
| (202.706) | Vistra Corp | Morgan Stanley | 35.622 | 0,00 |
| (1.298.164) | Vistra Corp | JPMorgan Chase Bank | 411.434 | 0,03 |
| (66.230) | Vital Farms Inc | Morgan Stanley | 14.056 | 0,00 |
| (130.168) | Vital Farms Inc | Goldman Sachs International | 20.713 | 0,00 |
| (12.999) | Vital Farms Inc | JPMorgan Chase Bank | 119 | 0,00 |
| (10.350) | Vizio Holding Corp Class A | Goldman Sachs International | 2.273 | 0,00 |
| 3.770 | Vizio Holding Corp Class A | Morgan Stanley | 726 | 0,00 |
| (21.689) | Vizio Holding Corp Class A | JPMorgan Chase Bank | 8.260 | 0,00 |
| 7.170.682 | Vodacom Group Ltd | JPMorgan Chase Bank | 8.195 | 0,00 |
| (30.788) | Vontier Corp | Morgan Stanley | 1.059 | 0,00 |
| (776) | Vornado Realty Trust | Morgan Stanley | 788 | 0,00 |
| (74) | Voya Financial Inc | Morgan Stanley | 23 | 0,00 |
| 98.369 | Voya Financial Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (120.420) | Vulcan Materials Co | Goldman Sachs International | 9.084 | 0,00 |
| (865.074) | Vulcan Materials Co | JPMorgan Chase Bank | 55.917 | 0,01 |
| (754) | Wabash National Corp | Morgan Stanley | 105 | 0,00 |
| (1.093.020) | Walgreens Boots Alliance Inc | Goldman Sachs International | 23.245 | 0,00 |
| (182) | Walmart Inc | Morgan Stanley | 1 | 0,00 |
| (665.854) | Walmart Inc | JPMorgan Chase Bank | 6.644 | 0,00 |
| 299.985 | Walmart Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (107.341) | Walt Disney Co | Morgan Stanley | 7.575 | 0,00 |
| 23.364 | Walt Disney Co | Goldman Sachs International | 59 | 0,00 |
| 54.348 | Walt Disney Co | JPMorgan Chase Bank | 953 | 0,00 |
| 5.070 | Warby Parker Inc Class A | Morgan Stanley | 7.393 | 0,00 |
| (76.968) | Warner Bros Discovery Inc | Morgan Stanley | 51.157 | 0,01 |
| (99.684) | Warner Music Group Corp Class A | Morgan Stanley | 11.819 | 0,00 |
| (1.477) | Warrior Met Coal Inc | Morgan Stanley | 360 | 0,00 |
| 319 | Waste Connections Inc | Morgan Stanley | 252 | 0,00 |
| 10.968.976 | Wayfair Inc Class A | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (360.730) | Wayfair Inc Class A | JPMorgan Chase Bank | 54.215 | 0,01 |
| (33.255) | Weatherford International Plc | JPMorgan Chase Bank | 2.863 | 0,00 |
| (94.761) | Weatherford International Plc | Goldman Sachs International | 3.521 | 0,00 |
| (672.127) | Weatherford International Plc | Morgan Stanley | 285.146 | 0,02 |
| 4.830 | Weave Communications Inc | Morgan Stanley | 1.440 | 0,00 |
| (72.146) | Webster Financial Corp | Morgan Stanley | 24.040 | 0,00 |
| 4.200.000 | Wendel SE | BNP Paribas | 292.435 | 0,02 |
| (86.958) | Wendy's Co | Morgan Stanley | 5.633 | 0,00 |
| (408) | Werner Enterprises Inc | Morgan Stanley | 260 | 0,00 |
| (335) | WESCO International Inc | Morgan Stanley | 107 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|----------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (20.227) | West Pharmaceutical Services Inc | Morgan Stanley | 138 | 0,00 |
| (364.814) | West Pharmaceutical Services Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (70.827) | Western Alliance Bancorp | Morgan Stanley | 35.947 | 0,00 |
| 537.947 | Western Digital Corp | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (209.220) | Western Digital Corp | Morgan Stanley | 55.336 | 0,01 |
| 7.361 | Western Union Co | Morgan Stanley | 681 | 0,00 |
| (1.803) | Westlake Corp | Morgan Stanley | 3.382 | 0,00 |
| (88.446) | WEX Inc | Morgan Stanley | 5.425 | 0,00 |
| 83.727 | Whirlpool Corp | Morgan Stanley | 1.724 | 0,00 |
| 42.170 | White Mountains Insurance Group | Morgan Stanley | 58 | 0,00 |
| 164.828 | Whitecap Resources Inc | JPMorgan Chase Bank | 13.225 | 0,00 |
| 385.693 | Whitecap Resources Inc | Goldman Sachs International | 36.044 | 0,00 |
| (4.233) | Whitestone REIT | Morgan Stanley | 491 | 0,00 |
| 235 | Wide Open West Inc | Morgan Stanley | 36 | 0,00 |
| 933.584 | Williams Cos Inc | Goldman Sachs International | 27.785 | 0,00 |
| (18.471) | Williams Cos Inc | Morgan Stanley | 70 | 0,00 |
| (931) | Williams-Sonoma Inc | Morgan Stanley | 622 | 0,00 |
| 1.172 | Wills Towers Watson Plc | Morgan Stanley | 4.698 | 0,00 |
| 323.053 | Wingstop Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 1.887.066 | Winnebago Industries Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| (564) | Wintrust Financial Corp | Morgan Stanley | 118 | 0,00 |
| (15.844) | Wix.Com Ltd | Morgan Stanley | 2.581 | 0,00 |
| (32.876) | Wix.Com Ltd | Goldman Sachs International | 14.590 | 0,00 |
| (53.201) | Wix.Com Ltd | JPMorgan Chase Bank | 14.763 | 0,00 |
| 97 | Wix.com Ltd | Morgan Stanley | 212 | 0,00 |
| 6.534 | WK Kellogg Co | Morgan Stanley | 3.683 | 0,00 |
| 100.664 | Wolfspeed Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 6.625 | Wolfspeed Inc | Morgan Stanley | 2.077 | 0,00 |
| (2.512.918) | Woolworths Holdings Ltd | JPMorgan Chase Bank | 1.609 | 0,00 |
| (2.020.289) | Woolworths Holdings Ltd | Morgan Stanley | 1.496 | 0,00 |
| (2.159.048) | Woolworths Holdings Ltd | Goldman Sachs International | 706 | 0,00 |
| (5.438) | Workday Inc Class A | JPMorgan Chase Bank | 63 | 0,00 |
| (79.836) | Workday Inc Class A | Morgan Stanley | 22.054 | 0,00 |
| (38.968) | Workday Inc Class A | Goldman Sachs International | 9.718 | 0,00 |
| (1.813) | World Kinect Corp | Morgan Stanley | 505 | 0,00 |
| (69.651) | Worldline SA | Goldman Sachs International | 1.315 | 0,00 |
| (547) | Worthington Enterprises Inc | Morgan Stanley | 457 | 0,00 |
| (567) | WP Carey Inc | Morgan Stanley | 179 | 0,00 |
| 467 | WW Grainger Inc | Morgan Stanley | 3.105 | 0,00 |
| (227.079) | Wyndham Hotels & Resorts Inc | Morgan Stanley | 40.555 | 0,00 |
| (605.089) | Wynn Resorts Ltd | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 8.998 | Xcel Energy Inc | Morgan Stanley | 82 | 0,00 |
| (5.955) | Xerox Holdings Corp | Morgan Stanley | 1.145 | 0,00 |
| (179.462) | XP Inc Class A | Goldman Sachs International | 18.942 | 0,00 |
| (81.573) | XP Inc Class A | Morgan Stanley | 9.256 | 0,00 |
| (675.947) | XPO Inc | Morgan Stanley | 160.745 | 0,01 |
| (544.429) | XPO Inc | Goldman Sachs International | 95.125 | 0,01 |
| (1.168.638) | XPO Inc | JPMorgan Chase Bank | 330.148 | 0,02 |
| 9.092 | Xponential Fitness Inc Class A | Morgan Stanley | 6.138 | 0,00 |
| 4.530 | Xylem Inc | Morgan Stanley | 14.524 | 0,00 |
| 900.711.520 | Yaoko Co Ltd | Société Générale | 0 | 0,00 |
| (19.145) | YETI Holdings Inc | Morgan Stanley | 4.011 | 0,00 |
| 4.655 | Yext Inc | Morgan Stanley | 551 | 0,00 |
| (18.307) | Zai Lab Ltd | Morgan Stanley | 203 | 0,00 |
| (3.273) | Zealand Pharma A/S | Morgan Stanley | 67 | 0,00 |
| (1.742.916) | Zealand Pharma A/S | JPMorgan Chase Bank | 55.499 | 0,01 |
| 13.324 | Zeta Global Holdings Corp Class A | Morgan Stanley | 11 | 0,00 |
| 140 | Ziff Davis Inc | Morgan Stanley | 39 | 0,00 |
| (661.417) | Zimmer Biomet Holdings Inc | Goldman Sachs International | 61.576 | 0,01 |
| 789 | Zimmer Biomet Holdings Inc | Morgan Stanley | 550 | 0,00 |
| 169 | Zoetis Inc | Morgan Stanley | 52 | 0,00 |
| (125.215) | Zoom Video Communications Inc Class A | Morgan Stanley | 7.708 | 0,00 |
| 431 | Zscaler Inc | Morgan Stanley | 300 | 0,00 |
| 4.570.240 | ZTO Express Cayman Inc | Goldman Sachs International | 0 | 0,00 |
| 100 | Zumiez Inc | Morgan Stanley | 115 | 0,00 |
| 8.913 | Zuora Inc Class A | Morgan Stanley | 3.592 | 0,00 |
| (5.637) | Zurn Elkay Water Solutions Corp | Morgan Stanley | 2.726 | 0,00 |
| 4.475 | Zynex Inc | Morgan Stanley | 1.737 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Differenzkontrakten [∞] | | | 106.923.561 | 6,57 |

Gekaufte Swaptions 0,00 % (31. Dezember 2022: 0,04 %)

| Anzahl Kontrakte | Fälligkeit | Beschreibung | Gegenpartei | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|---|------------|---|---------------------|---------------|----------------------|
| Call Swaption | | | | | |
| 525.000.000 EUR | 17.01.2024 | EUR Swaption, upon potential exercise of the option, the Portfolio will enter into swap with the notional value of EUR 525,000,000, in which it will pay a rate of 1.00%, and will receive iTraxx EUR S40, strike 1.05% | JPMorgan Chase Bank | 40.202 | 0,00 |
| Beizulegender Zeitwert aus gekauften Swaptions insgesamt [∞] (Prämie: 713.048 US\$) | | | | 40.202 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Credit-Default-Swap-Kontrakte 0,04 % (31. Dezember 2022: 0,05 %)

| Nominalwert | Datum der Schließung | Gegenpartei | Referenz-obligation | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|---|----------------------|-----------------------------|---|----------------|----------------------|
| 6.000.000 USD | 20.12.2027 | JPMorgan Chase Bank | Buying default protection on Sasol Financing USA LLC, 4.50%, 08/11/2027 | 617.434 | 0,04 |
| 17.700.000 USD | 20.06.2025 | Goldman Sachs International | Buying default protection on Meituan, 2.13%, 28/10/2025 | 65.132 | 0,00 |
| 1.000.000 USD | 20.06.2025 | Goldman Sachs International | Buying default protection on Meituan, 2.13%, 28/10/2025 | 3.680 | 0,00 |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt [±] | | | | 686.246 | 0,04 |

Zinsswap-Kontrakte 0,23 % (31. Dezember 2022: 2,10 %)

| Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei | Erhalt/(Zahlung) [#] | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|------------|--|-------------------------------|-----------------|--------------------|--------------------------------|----------------------|
| SEK 1.041.850.000 | 20.03.2026 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 2,97 % | 3M STIBOR | 587.409 | 0,04 |
| SEK 991.600.000 | 20.03.2026 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 2,96 % | 3M STIBOR | 530.955 | 0,03 |
| EUR 2.040.000.000 | 20.03.2024 | Merrill Lynch International | Erhalt | 3,80 % | 1D €STR | 508.386 | 0,03 |
| HUF 1.633.000.000 | 20.12.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 7,50 % | 6M BUBOR | 359.396 | 0,02 |
| JPY 2.698.000.000 | 20.09.2033 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 0,65 % | 12M JPY LIBOR | 349.579 | 0,02 |
| SEK 591.600.000 | 20.03.2026 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 2,92 % | 3M STIBOR | 279.861 | 0,02 |
| USD 19.800.000 | 28.09.2033 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 3,75 % | 1D SOFR | 272.504 | 0,02 |
| USD 45.895.000 | 18.12.2029 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 3,32 % | 1D SOFR | 185.559 | 0,01 |
| CZK 3.502.500.000 | 25.04.2024 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 6,30 % | 1D PRIBOR | 156.470 | 0,01 |
| AUD 54.900.000 | 20.03.2029 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 4,01 % | 6M BBSW | 152.917 | 0,01 |
| CZK 3.525.000.000 | 25.04.2024 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 6,32 % | 1D PRIBOR | 149.658 | 0,01 |
| USD 30.600.000 | 18.12.2029 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 3,31 % | 1D SOFR | 112.945 | 0,01 |
| CZK 3.487.500.000 | 25.04.2024 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 6,55 % | 1D PRIBOR | 59.129 | 0,00 |
| ZAR 33.060.000 | 20.12.2033 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 9,23 % | 3M JIBAR | 12.981 | 0,00 |
| ZAR 121.180.000 | 20.12.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 8,07 % | 3M JIBAR | 6.865 | 0,00 |
| PLN 100.000 | 15.12.2026 | Intercontinental Exchange ¹ | Erhalt | 1,44 % | 6M WIBOR | 2.171 | 0,00 |
| ZAR 135.490.000 | 20.12.2025 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 7,78 % | 3M JIBAR | 297 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten [™] | | | | | | 3.727.082 | 0,23 |

[#]Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

¹Zentral abgewickelter Swap.

Total Return Swap-Kontrakte 0,21 % (31. Dezember 2022: 0,12 %)

| Nominalwert | Datum der Schließung | Variabler Zinssatz | Referenzunternehmen | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|----------------|----------------------|--------------------|--|--------------------------------|----------------------|
| 33.765.579 USD | 28.02.2024 | 5,58 ¹ | Société Générale Basket SGBVRRU ² | 2.229.122 | 0,14 |
| 96.753.102 USD | 24.04.2025 | 0,00 ³ | Goldman Sachs Basket GSVIDI1B ⁴ | 517.673 | 0,03 |
| 16.542.900 EUR | 05.03.2024 | 0,00 ³ | UBS Basket UBCSFVPR ⁵ | 264.288 | 0,02 |
| 1.095.104 USD | 06.11.2024 | 5,76 ⁶ | Morgan Stanley Basket MSNBUIHI ⁷ | 100.877 | 0,01 |
| 413.740 USD | 06.11.2024 | 5,76 ⁶ | Morgan Stanley Basket MSNBUXBI ⁷ | 81.733 | 0,01 |
| 547.794 USD | 06.11.2024 | 5,76 ⁶ | Morgan Stanley Basket MSNBUIWM ⁷ | 63.806 | 0,00 |
| 424.556 USD | 21.03.2024 | 4,98 ⁶ | Goldman Sachs Basket GSUCPSS ² | 41.653 | 0,00 |
| (548.751) USD | 25.06.2024 | 4,92 ⁸ | JPMorgan Basket JP1STP ⁹ | 34.922 | 0,00 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Total Return Swap-Kontrakte 0,21 % (31. Dezember 2022: 0,12 %) (Fortsetzung)

| Nominalwert | Datum der Schließung | Variabler Zinssatz | Referenzunternehmen | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|----------------------|---------------------|---|--------------------------------|----------------------|
| (1.319.530) USD | 06.11.2024 | 5,11 ⁶ | Morgan Stanley Basket MSNBUXLP ⁷ | 22.039 | 0,00 |
| (1.393.969) USD | 09.02.2024 | 4,92 ⁸ | JPMorgan Basket JP1STP ⁹ | 14.601 | 0,00 |
| (1.718.065) USD | 24.09.2024 | (0,80) ³ | Morgan Stanley Basket MSCBSMMU ⁷ | 6.023 | 0,00 |
| (692.566) USD | 24.09.2024 | (0,80) ³ | Morgan Stanley Basket MSCBSMMU ⁷ | 5.631 | 0,00 |
| (1.267.724) USD | 06.11.2024 | 4,03 ⁶ | Morgan Stanley Basket MSACHDGE ⁷ | 5.340 | 0,00 |
| (743.053) USD | 10.06.2024 | 4,92 ⁸ | JPMorgan Basket JPAYBIO1 ⁹ | 4.415 | 0,00 |
| (261.164) USD | 06.11.2024 | 4,93 ⁶ | Morgan Stanley Basket MSACTACT ⁷ | 1.780 | 0,00 |
| (531.544) USD | 06.11.2024 | 5,11 ⁶ | Morgan Stanley Basket MSNBUSPY ⁷ | 651 | 0,00 |
| (627.028) USD | 17.06.2033 | 5,40 ¹ | Goldman Sachs Basket GSXUEDEF ⁴ | 484 | 0,00 |
| (20.566) USD | 29.04.2025 | 5,08 ⁶ | Morgan Stanley Basket MSNBUXOP ⁷ | 246 | 0,00 |
| 3.959 USD | 06.11.2024 | 5,11 ⁶ | Morgan Stanley Basket MSNBUSPY ⁷ | 179 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Total Return Swap-Kontrakten [∞] | | | | 3.395.463 | 0,21 |

¹ Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist der 1-Tag-SOFR.

² Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist Société Générale.

³ Fester Zinssatz.

⁴ Die Gegenpartei für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist Goldman Sachs International.

⁵ Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist UBS AG.

⁶ Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist der 1-Tag-FEDEF.

⁷ Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist Morgan Stanley.

⁸ Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist der 1-Tag-OBFR.

⁹ Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist die JPMorgan Chase Bank.

Correlation-Swap-Kontrakte 0,02 % (31. Dezember 2022: 0,02 %)

| Nominalwert | Datum der Schließung | Gegenpartei | Referenz-obligation | Korrelation zum Ausübungszeitpunkt in Prozent | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|----------------------|-------------|---|---|--------------------------------|----------------------|
| 5.000.000 USD | 20.12.2024 | BNP Paribas | Basket of S&P 500 /Nikkei 225 Index correlation swap 20/12/2024 | 80,50 % | 379.911 | 0,02 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Correlation-Swap-Kontrakten [∞] | | | | | 379.911 | 0,02 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Inflation-Swap-Kontrakte 0,24 % (31. Dezember 2022: 0,03 %)

| Vega Nominalwert | Datum der Schließung | Gegenpartei | Referenzobligation | Variance-Ausübungssatz | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|----------------------|-----------------------------|--|------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 500.000 USD | 19.01.2024 | Citibank NA | CITI 19 Names US Basket | Verschiedene | 1.146.934 | 0,07 |
| 325.000 USD | 19.12.2025 | Citibank NA | Russell 2000 Index vs S&P 500 Index | 25 / 22,1 | 662.082 | 0,04 |
| 884.000 USD/ 638.000 USD | 20.11.2024 | Goldman Sachs International | GS 128 Pairwise Theta Flat CoVol | Verschiedene | 364.531 | 0,02 |
| 250.000 EUR | 21.03.2025 | BNP Paribas | Euro Stoxx 50 Index vs FTSE 100 Index | 16,00 / 15,05 | 349.372 | 0,02 |
| 400.000 USD | 20.12.2024 | UBS | UBS 35 Names US Basket | Verschiedene | 247.689 | 0,02 |
| 400.000 USD | 20.12.2024 | Goldman Sachs International | Russell 2000 Index vs S&P 500 Index | 25,69 / 28,15 | 167.030 | 0,01 |
| 250.000 USD | 20.12.2024 | UBS | UBS 50 Names Global Basket | Verschiedene | 154.439 | 0,01 |
| 400.000 USD | 20.12.2024 | BNP Paribas | BNP US Geo Basket | Verschiedene | 118.880 | 0,01 |
| 200.000 EUR | 20.12.2024 | BNP Paribas | IBEX 35 Index vs FTSE 100 Index | 22,09 / 21,64 | 97.317 | 0,01 |
| 500.000 USD | 19.12.2025 | BNP Paribas | Euro Stoxx 50 Index vs S&P 500 Index | 29,03 / 32,03 | 95.896 | 0,01 |
| 100.000 GBP | 19.12.2025 | BNP Paribas | DAX 40 Index vs FTSE 100 Index | 16,60 / 14,40 | 87.982 | 0,01 |
| 240.000 USD | 20.12.2024 | Goldman Sachs International | Euro Stoxx 50 Index vs S&P 500 Index | 22,00 / 24,35 | 85.377 | 0,01 |
| 125.000 USD | 13.06.2025 | BNP Paribas | S&P 500 Index vs Nikkei 225 Index | 16,00 / 19,60 | 76.722 | 0,00 |
| 100.000 USD | 23.02.2024 | Goldman Sachs International | GS 5 Index Thematic | Verschiedene | 65.476 | 0,00 |
| 100.000 USD | 19.12.2025 | BNP Paribas | Euro Stoxx 50 Index vs S&P 500 Index | 27,55 / 30,7 | 29.861 | 0,00 |
| 300.000 EUR | 31.07.2024 | Goldman Sachs International | GS 6 Index Thematic | Verschiedene | 28.314 | 0,00 |
| 75.000 EUR | 19.12.2025 | BNP Paribas | FTSE MIB Index vs Nikkei 225 Index | 16,60 / 18,40 | 18.150 | 0,00 |
| 75.000 USD | 17.01.2024 | Goldman Sachs International | GS 5 Index Thematic | Verschiedene | 16.837 | 0,00 |
| 500.000 USD | 20.12.2024 | Citibank NA | Russell 2000 Index vs Nasdaq-100 Index | 33,80 / 34,00 / 35,00 | 15.323 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Variance-Swap-Kontrakten [∞] | | | | | 3.828.212 | 0,24 |

Volatility-Swap-Kontrakte 1,13 % (31. Dezember 2022: 1,03 %)

| Nominalwert | Datum der Schließung | Gegenpartei | Referenzobligation ¹ | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------------|----------------------|-----------------------------|---|--------------------------------|----------------------|
| 110.000.000 EUR | 20.06.2024 | BNP | BNP 20 Names Slider European Basket | 4.011.375 | 0,25 |
| 100.000.000 EUR | 21.06.2024 | BNP | BNP 30 Names Slider European Basket | 3.108.949 | 0,19 |
| 75.000.000 EUR | 21.06.2024 | BNP | BNP 19 Names EU and US Slider Basket | 2.376.298 | 0,15 |
| 174.971.819 USD | 12.01.2024 | Goldman Sachs International | GS 300 Pairwise Theta Flat CoVol ² | 1.112.751 | 0,07 |
| 30.000.000 USD | 19.01.2024 | UBS | UBS 29 Names US Basket | 774.964 | 0,05 |
| 50.000.000 USD | 17.01.2025 | Citibank NA | CITI 21 Names US Basket | 761.673 | 0,05 |
| 50.000.000 USD | 19.01.2024 | Citibank NA | CITI 18 Names US Basket | 645.494 | 0,04 |
| 30.000.000 EUR | 21.06.2024 | BofA Securities | BAML 14 Names EU Basket | 503.559 | 0,03 |
| 20.000.000 USD | 19.01.2024 | BofA Securities | BAML 17 Names US Basket | 351.516 | 0,02 |
| 40.000.000 EUR | 20.12.2024 | BNP | BNP 15 Names EU Basket | 373.890 | 0,02 |
| 20.000.000 USD | 19.01.2024 | UBS | UBS 25 Names US Basket | 334.327 | 0,02 |
| 30.000.000 USD | 20.06.2025 | Nomura | Nomura 20 Names Global Basket | 320.322 | 0,02 |
| 25.000.000 USD | 17.01.2025 | BofA Securities | BAML 17 Names US Basket | 309.864 | 0,02 |
| 60.000.000 EUR | 20.12.2024 | BNP | BNP Down Pairwise EU Basket | 308.862 | 0,02 |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Volatility-Swap-Kontrakte 1,13 % (31. Dezember 2022: 1,03 %) (Fortsetzung)

| Nominalwert | Datum der Schließung | Gegenpartei | Referenzobligation ¹ | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|----------------------|------------------|-------------------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 20.000.000 EUR | 20.12.2024 | BNP | BNP 10 Names EU Down Geo Basket | 300.241 | 0,02 |
| 20.487.000 USD | 21.06.2024 | Société Générale | SG 15 Names Global Basket | 291.000 | 0,02 |
| 6.000.000.000 EUR | 20.12.2024 | BNP | BNP 5 Names EU Basket | 269.822 | 0,02 |
| 25.000.000 EUR | 20.12.2024 | BofA Securities | BAML 16 Names EU Basket | 250.779 | 0,02 |
| 20.000.000 EUR | 20.12.2024 | BNP | BNP 15 Names EU Basket | 220.249 | 0,01 |
| 35.000.000 EUR | 18.12.2026 | BNP | BNP 25 Names EU Basket | 223.579 | 0,01 |
| 20.000.000 USD | 19.01.2024 | UBS | UBS 10 Names US Vanilla Basket | 216.868 | 0,01 |
| 20.000.000 USD | 17.01.2025 | Société Générale | SG 13 Names US Basket | 212.000 | 0,01 |
| 20.000.000 USD | 17.01.2025 | UBS | UBS 17 Names US Basket | 176.314 | 0,01 |
| 10.000.000 EUR | 21.06.2024 | Société Générale | SG 10 Names EU Basket | 168.056 | 0,01 |
| 25.000.000 USD | 17.01.2025 | UBS | UBS 39 Names US Basket | 156.013 | 0,01 |
| 12.500.000 EUR | 20.12.2024 | BNP | BNP 20 Names EU Basket | 140.967 | 0,01 |
| 10.000.000 EUR | 20.12.2024 | BNP | BNP 20 Names EU Basket | 140.278 | 0,01 |
| 7.500.000 USD | 19.01.2024 | UBS | UBS 39 Names US Basket | 81.009 | 0,01 |
| 11.500.000 USD | 20.12.2024 | BNP | BNP 16 Names EU Basket | 60.499 | 0,00 |
| 26.666.700 USD | 20.12.2024 | Société Générale | SG 15 Names Global Basket | 56.000 | 0,00 |
| 125.000 EUR | 20.12.2024 | BNP | BNP 5 Names EU Down Geo Basket | 9.683 | 0,00 |
| 125.000 EUR | 20.12.2024 | BNP | BNP 5 Names EU Down Geo Basket | 9.683 | 0,00 |
| 125.000 EUR | 20.12.2024 | BNP | BNP 5 Names EU Down Geo Basket | 9.683 | 0,00 |
| 6.250.000 EUR | 20.12.2024 | BNP | BNP 20 Names EU Basket | 38.851 | 0,00 |
| 10.000.000 EUR | 20.06.2024 | BNP | BNP 20 Names Slider European Basket | 36.042 | 0,00 |
| 20.000.000 EUR | 21.06.2024 | BofA Securities | BAML 9 Names EU Basket | 35.033 | 0,00 |
| 62.500 EUR | 20.12.2024 | BNP | BNP 5 Names EU Down Geo Basket | 4.841 | 0,00 |
| 62.500 EUR | 20.12.2024 | BNP | BNP 5 Names EU Down Geo Basket | 4.841 | 0,00 |
| 25.000.000 USD | 21.06.2024 | Société Générale | SG 23 Names Global Basket | 20.000 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Volatility-Swap-Kontrakten [∞] | | | | 18.426.175 | 1,13 |

¹Die Volatilitäten lauten auf verschiedene Fremdwährungen, je nach den Landeswährungen der Positionen in den Swaps.

² Bei Volatilität gehandelter Dispersion-Swap.

| | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|--|----------------------|---------------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 1.476.262.171 | 90,75 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (3,25 %) (31. Dezember 2022: (1,21 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|-------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 520.000 AUD | 356.981 US\$ | 20.03.2024 | BNP Paribas | 2 | (1.328) | (0,00) |
| 1.400.000 AUD | 134.195.056 ¥ | 21.03.2024 | Citibank NA | 9 | (6.084) | (0,00) |
| 460.000 AUD | 315.117 US\$ | 20.03.2024 | Citibank NA | 3 | (499) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (3,25 %) (31. Dezember 2022: (1,21 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 600.000 AUD | 411.324 US\$ | 20.03.2024 | Deutsche Bank AG | 3 | (953) | (0,00) |
| 560.000 AUD | 53.949.139 ¥ | 21.03.2024 | Deutsche Bank AG | 6 | (4.378) | (0,00) |
| 80.480.000 AUD | 7.762.281.522 ¥ | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 6 | (192.256) | (0,01) |
| 18.800.000 AUD | 16.963.635 CAD | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | (35.226) | (0,01) |
| 1.840.000 AUD | 176.573.551 ¥ | 21.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 12 | (9.451) | (0,00) |
| 190.000 AUD | 130.214 US\$ | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 3 | (264) | (0,00) |
| 80.000 AUD | 7.627.152 ¥ | 21.03.2024 | UBS AG | 1 | (52) | (0,00) |
| 1.290.000 AUD | 884.525 US\$ | 20.03.2024 | UBS AG | 7 | (2.230) | (0,00) |
| 1.560.000 BRL | 319.658 US\$ | 20.03.2024 | Deutsche Bank AG | 3 | (861) | (0,00) |
| 4.370.758 BRL | 900.000 US\$ | 03.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | (223) | (0,00) |
| 1.410.000 BRL | 288.978 US\$ | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 3 | (835) | (0,00) |
| 6.110.000 BRL | 1.256.775 US\$ | 20.03.2024 | UBS AG | 6 | (8.154) | (0,00) |
| 800.000 CAD | 607.644 US\$ | 20.03.2024 | BNP Paribas | 3 | (292) | (0,00) |
| 21.267.494 CAD | 23.800.000 AUD | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 3 | (112.974) | (0,01) |
| 54.400.000 CAD | 5.850.958.426 ¥ | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 5 | (287.394) | (0,02) |
| 17.000.000 CHF | 2.859.058.300 ¥ | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (89.113) | (0,01) |
| 54.710.000 CLP | 63.354 US\$ | 20.03.2024 | BNP Paribas | 1 | (957) | (0,00) |
| 694.722.130 CLP | 800.000 US\$ | 08.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (4.557) | (0,00) |
| 345.310.200 CLP | 400.000 US\$ | 12.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (4.705) | (0,00) |
| 523.900.623 CLP | 600.000 US\$ | 26.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (914) | (0,00) |
| 44.890.000 CLP | 51.607 US\$ | 20.03.2024 | Morgan Stanley | 1 | (409) | (0,00) |
| 58.316.581 CNY | 8.200.000 US\$ | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | (5.901) | (0,00) |
| 386.206.891 COP | 100.000 US\$ | 02.02.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (973) | (0,00) |
| 3.430.000 CZK | 154.239 US\$ | 20.03.2024 | BNP Paribas | 1 | (1.083) | (0,00) |
| 6.990.000 CZK | 313.157 US\$ | 20.03.2024 | Citibank NA | 2 | (1.041) | (0,00) |
| 1.190.000 CZK | 53.289 US\$ | 20.03.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | (153) | (0,00) |
| 3.700.000 CZK | 165.601 US\$ | 20.03.2024 | UBS AG | 1 | (390) | (0,00) |
| 577.439.993 EGP | 14.152.941 US\$ | 20.03.2024 | Morgan Stanley | 1 | (989.980) | (0,06) |
| 675.574 € | 2.950.000 PLN | 20.03.2024 | Citibank NA | 6 | (797) | (0,00) |
| 440.000 € | 488.280 US\$ | 20.03.2024 | Deutsche Bank AG | 4 | (708) | (0,00) |
| 28.625.000 € | 42.061.335 CAD | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 5 | (272.971) | (0,02) |
| 3.125.000 € | 3.469.536 US\$ | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | (16.581) | (0,00) |
| 24.625.000 € | 278.305.652 SEK | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 3 | (413.945) | (0,03) |
| 27.375.000 € | 44.726.571 AUD | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 8 | (278.218) | (0,02) |
| 29.625.000 € | 343.707.457 NOK | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 3 | (1.115.893) | (0,07) |
| 36.300.000 € | 5.726.916.621 ¥ | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 8 | (557.524) | (0,04) |
| 37.900.000 € | 32.918.595 £ | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 5 | (88.783) | (0,01) |
| 6.250.000 € | 5.897.417 CHF | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 8 | (106.178) | (0,02) |
| 1.500.000 € | 1.668.357 US\$ | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 10 | (6.180) | (0,00) |
| 80.000 € | 89.023 US\$ | 20.03.2024 | UBS AG | 1 | (373) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (3,25 %) (31. Dezember 2022: (1,21 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 100.764 € | 440.000 PLN | 20.03.2024 | UBS AG | 2 | (119) | (0,00) |
| 40.000 £ | 51.026 US\$ | 20.03.2024 | Barclays Bank Plc | 1 | (15) | (0,00) |
| 20.000 £ | 25.553 US\$ | 20.03.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | (47) | (0,00) |
| 3.250.000 £ | 3.564.701 CHF | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 6 | (95.205) | (0,00) |
| 50.125.000 £ | 9.203.746.161 ¥ | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 9 | (1.454.367) | (0,09) |
| 375.000 £ | 480.174 US\$ | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (2.106) | (0,00) |
| 33.500.000 £ | 64.012.708 AUD | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 7 | (981.564) | (0,07) |
| 54.176.422 £ | 63.100.000 € | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 6 | (655.337) | (0,04) |
| 160.000 £ | 204.422 US\$ | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 5 | (375) | (0,00) |
| 840.400.605 HUF | 2.200.000 € | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 3 | (4.468) | (0,00) |
| 9.160.000 HUF | 26.420 US\$ | 20.03.2024 | UBS AG | 1 | (174) | (0,00) |
| 267.520.000 INR | 3.206.390 US\$ | 20.03.2024 | BNP Paribas | 9 | (2.920) | (0,00) |
| 61.890.000 INR | 741.979 US\$ | 20.03.2024 | Deutsche Bank AG | 4 | (865) | (0,00) |
| 66.545.509 INR | 800.000 US\$ | 12.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (678) | (0,00) |
| 2.042.333.561 INR | 24.583.739 US\$ | 19.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 31 | (59.647) | (0,00) |
| 8.325.856 INR | 100.000 US\$ | 29.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (69) | (0,00) |
| 137.170.000 INR | 1.644.078 US\$ | 20.03.2024 | Royal Bank of Scotland | 6 | (1.508) | (0,00) |
| 696.240.000 INR | 8.360.837 US\$ | 20.03.2024 | UBS AG | 10 | (23.575) | (0,00) |
| 39.938.618 ¥ | 420.000 AUD | 21.03.2024 | Barclays Bank Plc | 3 | (472) | (0,00) |
| 17.210.000 ¥ | 123.688 US\$ | 21.03.2024 | Citibank NA | 3 | (105) | (0,00) |
| 167.623.112 ¥ | 1.780.000 AUD | 21.03.2024 | Citibank NA | 12 | (13.785) | (0,00) |
| 28.554.744 ¥ | 300.000 AUD | 21.03.2024 | Deutsche Bank AG | 2 | (143) | (0,00) |
| 4.044.827.156 ¥ | 38.200.000 CAD | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 6 | (250.882) | (0,01) |
| 3.839.276.046 ¥ | 43.200.000 NZD | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 6 | (89.994) | (0,00) |
| 3.435.859.555 ¥ | 22.200.000 € | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 3 | (131.625) | (0,01) |
| 245.388.275 ¥ | 1.375.000 £ | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (10.405) | (0,00) |
| 6.816.536.700 ¥ | 71.680.000 AUD | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 6 | (517.470) | (0,02) |
| 2.878.681.648 ¥ | 17.500.000 CHF | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 3 | (366.045) | (0,02) |
| 100.000.000 ¥ | 710.552 US\$ | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (448) | (0,00) |
| 17.907.612 ¥ | 190.000 AUD | 21.03.2024 | Royal Bank of Scotland | 4 | (1.363) | (0,00) |
| 69.639.796 ¥ | 740.000 AUD | 21.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 5 | (6.062) | (0,00) |
| 109.640.000 KRW | 85.024 US\$ | 20.03.2024 | Barclays Bank Plc | 1 | (83) | (0,00) |
| 239.570.000 KRW | 185.632 US\$ | 20.03.2024 | BNP Paribas | 1 | (31) | (0,00) |
| 183.700.000 KRW | 143.152 US\$ | 20.03.2024 | Citibank NA | 2 | (835) | (0,00) |
| 162.860.000 KRW | 126.475 US\$ | 20.03.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | (303) | (0,00) |
| 693.925.000 KRW | 537.756 US\$ | 19.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (2.255) | (0,00) |
| 7.581.184.095 KRW | 5.862.244 US\$ | 18.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 11 | (12.308) | (0,00) |
| 337.120.000 KRW | 261.601 US\$ | 20.03.2024 | UBS AG | 2 | (425) | (0,00) |
| 2.860.000 MXN | 167.392 US\$ | 20.03.2024 | BNP Paribas | 1 | (627) | (0,00) |
| 6.745.000.000 NGN | 7.100.000 US\$ | 08.02.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (688.403) | (0,04) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (3,25 %) (31. Dezember 2022: (1,21 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 5.807.800.000 NGN | 7.100.000 US\$ | 19.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (1.009.617) | (0,06) |
| 5.829.100.000 NGN | 7.100.000 US\$ | 22.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (1.103.697) | (0,07) |
| 1.120.000 NOK | 110.703 US\$ | 20.03.2024 | BNP Paribas | 2 | (229) | (0,00) |
| 107.372.312 NOK | 10.600.000 US\$ | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (25.477) | (0,00) |
| 700.000 NOK | 69.086 US\$ | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | (40) | (0,00) |
| 1.180.000 NOK | 116.851 US\$ | 20.03.2024 | UBS AG | 3 | (458) | (0,00) |
| 43.600.000 NZD | 3.920.614.938 ¥ | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 5 | (234.329) | (0,01) |
| 66.187.356 NZD | 61.822.457 AUD | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 3 | (286.447) | (0,02) |
| 440.000 NZD | 278.957 US\$ | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 4 | (319) | (0,00) |
| 2.920.000 PHP | 52.788 US\$ | 20.03.2024 | UBS AG | 1 | (77) | (0,00) |
| 250.000 PLN | 57.349 € | 20.03.2024 | Barclays Bank Plc | 1 | (40) | (0,00) |
| 310.000 PLN | 71.438 € | 20.03.2024 | Citibank NA | 4 | (410) | (0,00) |
| 12.139.135 PLN | 2.800.000 € | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (7.011) | (0,01) |
| 190.000 PLN | 43.647 € | 20.03.2024 | UBS AG | 2 | (99) | (0,00) |
| 260.000 SEK | 26.051 US\$ | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | (173) | (0,00) |
| 248.251.802 SEK | 22.500.000 € | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 3 | (221.041) | (0,01) |
| 275.419.619 SEK | 283.745.979 NOK | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 3 | (607.846) | (0,05) |
| 170.807.242 SEK | 17.100.000 US\$ | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 3 | (146.527) | (0,01) |
| 60.000 SGD | 45.690 US\$ | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | (41) | (0,00) |
| 28.054.230 SGD | 21.300.000 US\$ | 02.02.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | (598) | (0,00) |
| 3.560.000 TRY | 113.180 US\$ | 20.03.2024 | BNP Paribas | 4 | (1.083) | (0,00) |
| 14.854.237 TRY | 430.000 € | 20.03.2024 | Citibank NA | 7 | (8.759) | (0,00) |
| 328.588.350 TRY | 10.410.004 US\$ | 20.03.2024 | Citibank NA | 6 | (63.368) | (0,01) |
| 1.340.000 TRY | 42.747 US\$ | 20.03.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | (553) | (0,00) |
| 1.190.000 TRY | 37.571 US\$ | 20.03.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | (100) | (0,00) |
| 316.600.125 TRY | 10.050.000 US\$ | 20.03.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (80.852) | (0,01) |
| 10.428.690 TRY | 300.000 € | 20.03.2024 | JPMorgan Chase Bank | 5 | (4.057) | (0,00) |
| 5.927.852 TRY | 200.000 US\$ | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | (453) | (0,00) |
| 10.430.000 TRY | 331.272 US\$ | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 5 | (2.851) | (0,00) |
| 102.749.060 TWD | 3.400.000 US\$ | 02.02.2024 | JPMorgan Chase Bank | 5 | (16.312) | (0,00) |
| 21.300.000 US\$ | 657.850.500 TWD | 02.02.2024 | Bank of America Merrill Lynch | 1 | (364.049) | (0,02) |
| 1.884.240 US\$ | 9.430.000 BRL | 20.03.2024 | Barclays Bank Plc | 8 | (42.846) | (0,00) |
| 57.741 US\$ | 75.120.000 KRW | 20.03.2024 | Barclays Bank Plc | 1 | (456) | (0,00) |
| 955.376 US\$ | 53.310.000 PHP | 20.03.2024 | Barclays Bank Plc | 1 | (6.964) | (0,00) |
| 167.480 US\$ | 148.980.000 CLP | 20.03.2024 | Barclays Bank Plc | 1 | (2.434) | (0,00) |
| 31.022 US\$ | 580.000 ZAR | 20.03.2024 | Barclays Bank Plc | 1 | (479) | (0,00) |
| 154.781 US\$ | 230.000 AUD | 20.03.2024 | Barclays Bank Plc | 4 | (2.527) | (0,00) |
| 609.259 US\$ | 480.000 £ | 20.03.2024 | Barclays Bank Plc | 13 | (2.882) | (0,00) |
| 87.577 US\$ | 80.000 € | 20.03.2024 | Barclays Bank Plc | 1 | (1.073) | (0,00) |
| 50.510 US\$ | 80.000 NZD | 20.03.2024 | Barclays Bank Plc | 2 | (152) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (3,25 %) (31. Dezember 2022: (1,21 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 761.467 US\$ | 13.500.000 MXN | 20.03.2024 | BNP Paribas | 2 | (25.710) | (0,00) |
| 1.354.502 US\$ | 14.860.000 NOK | 20.03.2024 | BNP Paribas | 6 | (111.258) | (0,01) |
| 34.072 US\$ | 50.000 AUD | 20.03.2024 | BNP Paribas | 1 | (126) | (0,00) |
| 1.433.025 US\$ | 50.410.000 THB | 20.03.2024 | BNP Paribas | 3 | (53.805) | (0,00) |
| 615.039 US\$ | 217.340.000 HUF | 20.03.2024 | BNP Paribas | 2 | (7.699) | (0,00) |
| 550.141 US\$ | 5.610.000 SEK | 20.03.2024 | BNP Paribas | 2 | (8.229) | (0,00) |
| 35.477 US\$ | 660.000 ZAR | 20.03.2024 | BNP Paribas | 1 | (369) | (0,00) |
| 1.924.951 US\$ | 107.450.000 PHP | 20.03.2024 | BNP Paribas | 7 | (14.713) | (0,00) |
| 52.892 US\$ | 210.000 PLN | 20.03.2024 | BNP Paribas | 2 | (457) | (0,00) |
| 189.181 US\$ | 250.000 SGD | 20.03.2024 | BNP Paribas | 1 | (1.022) | (0,00) |
| 103.192 US\$ | 8.620.000 INR | 20.03.2024 | BNP Paribas | 2 | (30) | (0,00) |
| 16.865 US\$ | 1.410.000 INR | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | (19) | (0,00) |
| 62.578 US\$ | 55.130.000 CLP | 20.03.2024 | Citibank NA | 2 | (299) | (0,00) |
| 2.248.781 US\$ | 3.010.000 SGD | 20.03.2024 | Citibank NA | 4 | (41.263) | (0,00) |
| 100.783 US\$ | 1.730.000 MXN | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | (93) | (0,00) |
| 1.262.201 US\$ | 13.750.000 NOK | 20.03.2024 | Citibank NA | 6 | (94.069) | (0,01) |
| 522.810 US\$ | 2.070.000 PLN | 20.03.2024 | Citibank NA | 6 | (3.048) | (0,00) |
| 1.268.160 US\$ | 24.290.000 ZAR | 20.03.2024 | Citibank NA | 6 | (51.075) | (0,00) |
| 86.801 US\$ | 140.000 NZD | 20.03.2024 | Citibank NA | 3 | (1.857) | (0,00) |
| 488.163 US\$ | 11.060.000 CZK | 20.03.2024 | Citibank NA | 4 | (5.686) | (0,00) |
| 100.449 US\$ | 131.870.000 KRW | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | (1.714) | (0,00) |
| 553.701 US\$ | 2.750.000 BRL | 20.03.2024 | Citibank NA | 4 | (8.281) | (0,00) |
| 291.489 US\$ | 430.000 AUD | 20.03.2024 | Citibank NA | 5 | (2.609) | (0,00) |
| 281.720 US\$ | 260.000 € | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | (6.391) | (0,00) |
| 304.101 US\$ | 240.000 £ | 20.03.2024 | Citibank NA | 7 | (1.969) | (0,00) |
| 460.227 US\$ | 164.800.000 HUF | 20.03.2024 | Citibank NA | 1 | (11.969) | (0,00) |
| 14.268.005 US\$ | 1.193.550.000 INR | 20.03.2024 | Deutsche Bank AG | 2 | (24.393) | (0,00) |
| 30.219 US\$ | 120.000 PLN | 20.03.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | (266) | (0,00) |
| 117.731 US\$ | 100.000 CHF | 20.03.2024 | Deutsche Bank AG | 2 | (2.036) | (0,00) |
| 465.597 US\$ | 430.000 € | 20.03.2024 | Deutsche Bank AG | 1 | (10.894) | (0,00) |
| 420.091 US\$ | 330.000 £ | 20.03.2024 | Deutsche Bank AG | 7 | (755) | (0,00) |
| 210.174 US\$ | 320.000 AUD | 20.03.2024 | Deutsche Bank AG | 2 | (8.690) | (0,00) |
| 652.445 US\$ | 11.380.000 MXN | 20.03.2024 | Deutsche Bank AG | 4 | (11.117) | (0,00) |
| 60.618 US\$ | 8.650.000 ¥ | 21.03.2024 | Deutsche Bank AG | 2 | (1.496) | (0,00) |
| 2.304.816 US\$ | 18.000.000 HKD | 05.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (434) | (0,00) |
| 1.829.520 US\$ | 1.500.000 £ | 31.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (83.001) | (0,01) |
| 35.500.000 US\$ | 1.112.037.500 TWD | 15.02.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (1.187.105) | (0,07) |
| 2.352.117 US\$ | 43.732.911 ZAR | 09.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (38.119) | (0,00) |
| 22.918.098 US\$ | 21.600.000 € | 31.01.2024 | Goldman Sachs International | 5 | (970.976) | (0,06) |
| 27.161.645 US\$ | 25.150.000 € | 05.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (622.423) | (0,04) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (3,25 %) (31. Dezember 2022: (1,21 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 20.808.048 US\$ | 3.050.000.000 ¥ | 05.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (833.046) | (0,05) |
| 14.200.000 US\$ | 440.910.000 TWD | 05.02.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | (325.885) | (0,02) |
| 11.073.048 US\$ | 211.308.226 ZAR | 09.01.2024 | HSBC Bank Plc | 2 | (476.071) | (0,03) |
| 35.500.000 US\$ | 1.096.417.500 TWD | 02.02.2024 | HSBC Bank Plc | 2 | (606.748) | (0,04) |
| 21.300.000 US\$ | 28.224.630 SGD | 02.02.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | (128.773) | (0,01) |
| 42.600.000 US\$ | 1.340.835.000 TWD | 16.02.2024 | HSBC Bank Plc | 1 | (1.641.467) | (0,10) |
| 580.840 US\$ | 20.630.000 THB | 20.03.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | (27.637) | (0,00) |
| 100.000 US\$ | 35.166.840 HUF | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (1.534) | (0,00) |
| 800.000 US\$ | 66.801.011 INR | 12.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 4 | (2.391) | (0,00) |
| 100.000 US\$ | 3.116.993 TWD | 22.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (2.451) | (0,00) |
| 7.900.000 US\$ | 245.468.800 TWD | 26.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (173.841) | (0,01) |
| 28.100.000 US\$ | 299.143.435 NOK | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 5 | (1.361.033) | (0,09) |
| 5.040.469 US\$ | 156.216.668 TWD | 19.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 5 | (91.491) | (0,00) |
| 200.000 US\$ | 265.286 SGD | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | (1.177) | (0,00) |
| 1.100.000 US\$ | 11.414.630 SEK | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 4 | (32.959) | (0,00) |
| 300.000 US\$ | 1.202.454.289 COP | 11.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | (9.896) | (0,00) |
| 4.474.651 US\$ | 16.556.207 ILS | 16.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (124.146) | (0,01) |
| 300.000 US\$ | 1.187.997 PLN | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (2.093) | (0,00) |
| 28.452.563 US\$ | 43.214.397 AUD | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 5 | (1.041.473) | (0,06) |
| 12.200.000 US\$ | 362.870.789 TRY | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | (15.215) | (0,00) |
| 37.579.351 US\$ | 34.625.000 € | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 8 | (679.389) | (0,04) |
| 100.000 US\$ | 402.725.559 COP | 12.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | (3.766) | (0,00) |
| 819.361 US\$ | 15.640.000 ZAR | 20.03.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | (30.077) | (0,00) |
| 227.232 US\$ | 81.170.000 HUF | 20.03.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (5.342) | (0,00) |
| 11.500.000 US\$ | 216.888.751 ZAR | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 4 | (353.156) | (0,02) |
| 3.205.724 US\$ | 267.415.385 INR | 04.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 4 | (7.700) | (0,00) |
| 28.815.070 US\$ | 2.403.959.724 INR | 11.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 22 | (61.762) | (0,00) |
| 700.000 US\$ | 618.446.849 CLP | 11.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | (8.024) | (0,00) |
| 4.338.096 US\$ | 3.750.000 CHF | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 6 | (120.691) | (0,01) |
| 118.849.824 US\$ | 160.900.000 CAD | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 9 | (3.187.138) | (0,20) |
| 361.362 US\$ | 1.760.560 BRL | 02.02.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (443) | (0,00) |
| 1.010.440 US\$ | 30.728.832 TWD | 05.02.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | (1.929) | (0,00) |
| 11.198.376 US\$ | 934.029.013 INR | 08.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 5 | (23.070) | (0,00) |
| 3.400.000 US\$ | 283.594.000 INR | 05.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (7.653) | (0,00) |
| 900.000 US\$ | 1.170.197.770 KRW | 05.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 5 | (6.829) | (0,00) |
| 22.301.115 US\$ | 110.097.505 BRL | 03.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 92 | (363.882) | (0,02) |
| 400.000 US\$ | 1.593.776.409 COP | 09.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (10.923) | (0,00) |
| 34.100.000 US\$ | 243.583.959 CNY | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 14 | (126.133) | (0,01) |
| 11.300.000 US\$ | 41.991.862 ILS | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | (362.297) | (0,02) |
| 100.000 US\$ | 8.343.400 INR | 18.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (191) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (3,25 %) (31. Dezember 2022: (1,21 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 18.504.100 US\$ | 1.542.613.058 INR | 19.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 4 | (19.411) | (0,00) |
| 51.565.942 US\$ | 7.437.500.000 ¥ | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 12 | (1.248.023) | (0,08) |
| 3.400.000 US\$ | 4.480.537.741 KRW | 04.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (75.537) | (0,01) |
| 200.000 US\$ | 259.985.545 KRW | 08.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (882) | (0,00) |
| 19.565.754 US\$ | 31.800.000 NZD | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 5 | (568.971) | (0,04) |
| 200.000 US\$ | 805.040.199 COP | 05.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (7.725) | (0,00) |
| 100.000 US\$ | 3.117.214 TWD | 08.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (2.051) | (0,00) |
| 200.000 US\$ | 6.269.233 TWD | 11.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 2 | (5.669) | (0,00) |
| 200.000 US\$ | 6.230.825 TWD | 12.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (4.444) | (0,00) |
| 200.000 US\$ | 797.206.225 COP | 19.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (5.074) | (0,00) |
| 7.393.587 US\$ | 229.241.202 TWD | 04.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 6 | (82.930) | (0,00) |
| 25.862.481 US\$ | 20.454.545 £ | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 12 | (213.965) | (0,01) |
| 15.980.830 US\$ | 1.333.939.579 INR | 16.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 3 | (39.113) | (0,00) |
| 600.000 US\$ | 792.673.690 KRW | 11.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 5 | (11.325) | (0,00) |
| 3.400.000 US\$ | 4.454.546.006 KRW | 16.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 17 | (36.765) | (0,00) |
| 7.900.000 US\$ | 247.880.704 TWD | 16.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 5 | (239.030) | (0,01) |
| 100.000 US\$ | 403.803.102 COP | 16.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (3.947) | (0,00) |
| 100.000 US\$ | 395.744.000 COP | 18.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (1.825) | (0,00) |
| 600.000 US\$ | 779.862.000 KRW | 12.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 1 | (1.491) | (0,00) |
| 11.120.269 US\$ | 192.821.915 MXN | 10.01.2024 | JPMorgan Chase Bank | 5 | (253.709) | (0,01) |
| 10.981.000 US\$ | 10.000.000 € | 22.03.2024 | NIPB | 2 | (101.125) | (0,01) |
| 3.431.430 US\$ | 2.700.000 £ | 22.03.2024 | NIPB | 1 | (11.885) | (0,00) |
| 569.967 US\$ | 31.860.000 PHP | 20.03.2024 | Royal Bank of Scotland | 1 | (5.163) | (0,00) |
| 138.289 US\$ | 120.000 CHF | 20.03.2024 | Royal Bank of Scotland | 4 | (5.432) | (0,00) |
| 69.158 US\$ | 110.000 NZD | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 2 | (501) | (0,00) |
| 466.076 US\$ | 370.000 £ | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 10 | (5.781) | (0,00) |
| 88.520 US\$ | 130.000 AUD | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 2 | (393) | (0,00) |
| 158.292 US\$ | 630.000 PLN | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 4 | (1.752) | (0,00) |
| 1.299.953 US\$ | 1.200.000 € | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 4 | (29.788) | (0,00) |
| 133.156 US\$ | 2.320.000 MXN | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 2 | (2.122) | (0,00) |
| 78.142 US\$ | 101.460.000 KRW | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | (461) | (0,00) |
| 254.585 US\$ | 1.260.000 BRL | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 3 | (2.904) | (0,00) |
| 78.794 US\$ | 1.790.000 CZK | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 2 | (1.133) | (0,00) |
| 75.866 US\$ | 100.000 SGD | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | (215) | (0,00) |
| 18.910 US\$ | 6.600.000 HUF | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | (1) | (0,00) |
| 1.507.057 US\$ | 1.280.000 CHF | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 21 | (25.967) | (0,00) |
| 41.892 US\$ | 780.000 ZAR | 20.03.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | (471) | (0,00) |
| 226.309 US\$ | 32.430.000 ¥ | 21.03.2024 | UBS AG | 1 | (6.567) | (0,00) |
| 129.313 US\$ | 168.890.000 KRW | 20.03.2024 | UBS AG | 2 | (1.530) | (0,00) |
| 1.031.106 US\$ | 57.590.000 PHP | 20.03.2024 | UBS AG | 3 | (8.497) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (3,25 %) (31. Dezember 2022: (1,21 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 167.095 US\$ | 1.730.000 SEK | 20.03.2024 | UBS AG | 3 | (5.093) | (0,00) |
| 1.207.024 US\$ | 42.730.000 THB | 20.03.2024 | UBS AG | 2 | (53.287) | (0,00) |
| 1.152.542 US\$ | 970.000 CHF | 20.03.2024 | UBS AG | 9 | (9.201) | (0,00) |
| 1.350.450 US\$ | 1.830.000 CAD | 20.03.2024 | UBS AG | 3 | (38.867) | (0,00) |
| 697.731 US\$ | 58.300.000 INR | 20.03.2024 | UBS AG | 1 | (393) | (0,00) |
| 22.250.000 ZAR | 1.217.061 US\$ | 20.03.2024 | BNP Paribas | 4 | (8.623) | (0,00) |
| 14.300.000 ZAR | 777.396 US\$ | 20.03.2024 | Citibank NA | 2 | (738) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> | | | | | | |
| 1.802.368 US\$ | 1.612.823 CHF | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 2 | (117.022) | (0,01) |
| 159.419 US\$ | 141.135 CHF | 18.01.2024 | UBS AG | 9 | (8.544) | (0,00) |
| 2.404.656 US\$ | 2.143.722 CHF | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 23 | (146.544) | (0,01) |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 241 € | 268 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (1) | (0,00) |
| 764.529 US\$ | 702.835 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | (12.341) | (0,00) |
| 2.681.425 US\$ | 2.518.463 € | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | (102.326) | (0,01) |
| 3.831.164 US\$ | 3.580.409 € | 18.01.2024 | UBS AG | 6 | (126.396) | (0,01) |
| 13.211.705 US\$ | 12.267.274 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 74 | (347.776) | (0,02) |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 32.120.603 £ | 41.008.739 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 4 | (57.804) | (0,00) |
| 9.200.888 US\$ | 7.591.110 £ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (477.107) | (0,03) |
| 44.360.580 US\$ | 35.665.365 £ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 4 | (1.109.612) | (0,07) |
| 23.928.056 US\$ | 19.460.251 £ | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | (882.048) | (0,05) |
| 446.445.225 US\$ | 363.121.258 £ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 70 | (16.502.342) | (1,02) |
| <i>Abgesicherte Klassen JPY</i> | | | | | | |
| 302.522 US\$ | 43.430.025 ¥ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (6.279) | (0,00) |
| 1.026.659 US\$ | 150.358.322 ¥ | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 5 | (42.436) | (0,00) |
| 1.111.191 US\$ | 165.071.219 ¥ | 18.01.2024 | UBS AG | 6 | (62.518) | (0,00) |
| 280.886 US\$ | 40.997.626 ¥ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (10.620) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i> | | | | | | |
| 93 US\$ | 126 SGD | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (3) | (0,00) |
| 63 US\$ | 83 SGD | 18.01.2024 | State Street Bank and Trust Co | 1 | (0) | (0,00) |
| 103 US\$ | 140 SGD | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (3) | (0,00) |
| 62.703 US\$ | 85.396 SGD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 19 | (2.081) | (0,00) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | (53.084.382) | (3,25) |

Futures-Kontrakte (1,51 %) (31. Dezember 2022: (0,81 %))

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|------------------|---|---------------------------------|----------------------|
| 300 | 3-Month Euro EURIBOR Put Option on Future February 2024, Strike Price EUR 95.00 | (309) | 0,00 |
| 300 | 3-Month Euro EURIBOR Put Option on Future January 2024, Strike Price EUR 95.38 | (2.364) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Futures-Kontrakte (1,51 %) (31. Dezember 2022: (0,81 %)) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|------------------|---|---------------------------------|----------------------|
| 300 | 3-Month Euro EURIBOR Call Option on Future January 2024, Strike Price EUR 97.38 | (2.364) | (0,00) |
| 3.000 | 3-Month Euro EURIBOR Put Option on Future March 2024, Strike Price EUR 96.00 | (82.907) | (0,01) |
| 1.500 | 3-Month Euro EURIBOR Put Option on Future March 2024, Strike Price EUR 96.25 | (225.842) | (0,01) |
| (38) | 3 Month SOFR Future June 2024 | (25.175) | (0,00) |
| (26) | 3 Month SOFR Future March 2024 | (1.462) | (0,00) |
| (718) | 3 Month SOFR Future March 2025 | (778.467) | (0,05) |
| (76) | 3 Month SOFR Future September 2025 | (21.875) | (0,00) |
| (2.072) | 30 Day Federal Funds Future February 2024 | (107.984) | (0,01) |
| (674) | 3-Month Euro EURIBOR Future December 2024 | (1.597.701) | (0,10) |
| (33) | 90-Day Bank Bill Future December 2024 | (17.506) | (0,00) |
| (1.312) | Australian Dollar Currency Future March 2024 | (2.906.134) | (0,19) |
| (183) | Australian Government Bond 10-Year Future March 2024 | (170.450) | (0,01) |
| (301) | Australian Government Bond 3-Year Future March 2024 | (165.734) | (0,01) |
| (106) | Bankers Acceptance Future December 2024 | (204.829) | (0,01) |
| (1.744) | Bankers Acceptance Future March 2024 | (319.079) | (0,02) |
| (202) | BIST 30 Index Future February 2024 | (3.283) | (0,00) |
| 9 | Brazil Real Currency Future January 2024 | (184.281) | (0,01) |
| (1.194) | British Pound Currency Future March 2024 | (631.877) | (0,04) |
| 467 | CAC40 Index Future January 2024 | (267.510) | (0,02) |
| (2.376) | Canadian 10-Year Bond Future March 2024 | (253.276) | (0,02) |
| (4) | Canadian 5-Year Bond Future March 2024 | (394) | (0,00) |
| 953 | Canadian Dollar Currency Future March 2024 | (150.781) | (0,01) |
| 47 | DAX Index Future March 2024 | (155.314) | (0,01) |
| (2) | E-mini Health Care Future March 2024 | (4.460) | (0,00) |
| (15) | E-mini Russell 2000 Index Future March 2024 | (80.063) | (0,01) |
| 1 | E-mini Utilities Future March 2024 | (180) | (0,00) |
| 1.035 | Euro Bund Call Option on Future February 2024, Strike Price EUR 139.00 | (114.478) | (0,01) |
| 225 | Euro Bund Call Option on Future February 2024, Strike Price EUR 142.00 | (9.167) | (0,00) |
| 224 | Euro Bund Put Option on Future February 2024, Strike Price EUR 132.00 | (9.567) | (0,00) |
| (75) | Euro-Buxl Put Option on Future February 2024, Strike Price EUR 135.00 | (33.575) | (0,01) |
| (1.050) | Euro FX Currency Future March 2024 | (2.582.758) | (0,17) |
| 295 | Euro Stoxx 50 Future March 2024 | (147.703) | (0,01) |
| (5) | Euro/Pound Sterling Currency Future March 2024 | (3.426) | (0,00) |
| 7 | Euro-BTP Future January 2024 | (528) | (0,00) |
| (368) | Euro-BTP Future March 2024 | (1.206.631) | (0,07) |
| 1.374 | Euro-Bund Future March 2024 | (1.382.323) | (0,08) |
| (396) | Euro-OAT Future March 2024 | (154.660) | (0,01) |
| (13) | FTSE 100 Index Future March 2024 | (22.475) | (0,00) |
| (344) | FTSE China A50 Index Future January 2024 | (108.495) | (0,01) |
| (34) | FTSE/JSE Top 40 Index Future March 2024 | (29.154) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Futures-Kontrakte (1,51 %) (31. Dezember 2022: (0,81 %)) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|------------------|--|---------------------------------|----------------------|
| 31 | FTSE/MIB Index Future March 2024 | (26.169) | (0,00) |
| 119 | IFSC Nifty50 Index Future January 2024 | (3.927) | (0,00) |
| (67) | Hang Seng China Enterprises Index Future January 2024 | (87.193) | (0,01) |
| (23) | Hang Seng Index Future January 2024 | (48.440) | (0,00) |
| (8) | Hang Seng TECH Index Future January 2024 | (6.935) | (0,00) |
| 14 | IBEX 35 Index Future January 2024 | (7.298) | (0,00) |
| 2 | IBEX 35 Mini Index Future January 2024 | (209) | (0,00) |
| (116) | Japan Government 10-Year Bond (OSE) Future March 2024 | (215.562) | (0,01) |
| (87) | Japanese Yen Currency Future March 2024 | (214.716) | (0,01) |
| 370 | KOSPI 200 Index Future December 2049 | (16.558) | (0,00) |
| 2 | Long Swiss Confederation Bond Future March 2024 | (582) | (0,00) |
| 4 | Mini-DAX Future March 2024 | (1.469) | (0,00) |
| (4) | Mini-Hang Seng China Enterprises Index Future January 2024 | (1.122) | (0,00) |
| (83) | Mini-Hang Seng Index Future January 2024 | (54.597) | (0,00) |
| (1) | MSCI China A 50 Index Future January 2024 | (945) | (0,00) |
| (26) | MSCI Emerging Markets Index Future March 2024 | (25.610) | (0,00) |
| (28) | MSCI Singapore Index Future January 2024 | (20.048) | (0,00) |
| (1.382) | New Zealand Dollar Currency Future March 2024 | (918.250) | (0,05) |
| 17 | Nikkei 225 (OSE) Future March 2024 | (89.516) | (0,00) |
| 9 | Norwegian Krone Currency Future March 2024 | (65.198) | (0,00) |
| (4) | S&P 500 Consumer Staples Index March 2024 | (8.310) | (0,00) |
| (100) | S&P 500 E-mini Future March 2024 | (86.296) | (0,01) |
| (120) | S&P/TSX 60 Index Future March 2024 | (124.283) | (0,01) |
| (3) | South African Rand Currency (CME) Future March 2024 | (300) | (0,00) |
| (895) | SPI 200 Index Future March 2024 | (870.235) | (0,05) |
| 66 | STOXX Europe 600 Index Future March 2024 | (10.127) | (0,00) |
| 2 | STOXX Europe 600 Insurance Future March 2024 | (663) | (0,00) |
| 3 | STOXX Europe 600 Utilities March 2024 | (1.823) | (0,00) |
| 5 | Swedish Krona Currency Future March 2024 | (17.995) | (0,00) |
| (96) | Swiss Franc Currency Future March 2024 | (422.703) | (0,03) |
| (1) | TAIEX Future January 2024 | (91) | (0,00) |
| (163) | Techpoint Inc Future January 2024 | (29.284) | (0,00) |
| 463 | United Kingdom Long Gilt Future March 2024 | (588.638) | (0,04) |
| (2.782) | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2024 | (5.306.058) | (0,32) |
| (88) | US Treasury 10-Year Ultra Future March 2024 | (97.547) | (0,01) |
| (8) | US Treasury 3-Year Note (CBT) Future | (1.523) | (0,00) |
| (1.153) | US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2024 | (1.025.246) | (0,05) |
| (39) | US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2024 | (3.063) | (0,00) |
| (116) | WIG 20 Index Future December 2049 | (10.313) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Futures-Kontrakte (1,51 %) (31. Dezember 2022: (0,81 %)) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|--|---------------------------------|----------------------|
| (81) | Yen Denominated Nikkei Future March 2024 | (18.015) | (0,00) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten * | | (24.593.398) | (1,51) |

Verkaufte Optionskontrakte (23,28 %) (31. Dezember 2022: (9,90 %))

| Anzahl Kontrakte/Nominalwert Betrag | Fälligkeit | Art | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------------------------------|------------|--|---------------|----------------------|
| Kaufoptionen | | | | |
| (130.036) | 01.08.2028 | Advanced Energy Industries Inc, Strike Price \$137.46 ^{oo} | (4.053.943) | (0,25) |
| (121.230) | 29.01.2029 | Akamai Technologies Inc, Strike Price \$126.31 ^{oo} | (4.304.190) | (0,27) |
| (125.000) | 15.08.2025 | Akamai Technologies Inc, Strike Price \$95.00 ^{oo} | (4.417.445) | (0,27) |
| (400.000) | 19.01.2024 | Apellis Pharmaceuticals Inc, Strike Price \$37.87 ^{oo} | (8.996.424) | (0,56) |
| (1.509) | 19.01.2024 | Apellis Pharmaceuticals Inc, Strike Price \$55.00 [±] | (1.418.460) | (0,09) |
| (1.575.000) | 15.01.2027 | BridgeBio Pharma Inc, Strike Price \$42.71 ^{oo} | (24.596.436) | (1,51) |
| (1.575.000) | 19.02.2027 | BridgeBio Pharma Inc, Strike Price \$42.71 ^{oo} | (25.021.546) | (1,54) |
| (450.000) | 19.01.2024 | Ceridian HCM Holding Inc, Strike Price \$92.30 ^{oo} | (14.676) | (0,00) |
| (117.000) | 20.11.2026 | Confluent Inc, Strike Price \$100.06 ^{oo} | (121.305) | (0,01) |
| (117.000) | 18.12.2026 | Confluent Inc, Strike Price \$100.06 ^{oo} | (130.196) | (0,01) |
| (116.000) | 15.01.2027 | Confluent Inc, Strike Price \$100.06 ^{oo} | (138.561) | (0,01) |
| (210.000) | 15.01.2027 | Conmed Corp, Strike Price \$139.47 ^{oo} | (4.241.190) | (0,26) |
| (1.395.000) | 20.12.2024 | Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR15.50 ^{oo} | (9.187.405) | (0,56) |
| (1.395.000) | 21.03.2025 | Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR15.50 ^{oo} | (9.351.603) | (0,57) |
| (47.396) | 21.06.2024 | Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR26.00 [±] | (104.712) | (0,01) |
| (5.000) | 15.09.2025 | Energizer Holdings Inc, Strike Price EUR15.53 ^{oo} | (877.248) | (0,05) |
| (334.375) | 29.08.2028 | Enovis Corp, Strike Price \$58.32 ^{oo} | (6.717.903) | (0,41) |
| (110.000) | 17.09.2027 | Envestnet Inc, Strike Price \$73.37 ^{oo} | (1.090.872) | (0,07) |
| (110.000) | 15.10.2027 | Envestnet Inc, Strike Price \$73.37 ^{oo} | (1.112.837) | (0,07) |
| (110.000) | 19.11.2027 | Envestnet Inc, Strike Price \$73.37 ^{oo} | (1.140.124) | (0,07) |
| (300.000) | 15.06.2029 | Fluor Corp, Strike Price \$45.50 ^{oo} | (4.241.207) | (0,26) |
| (300.000) | 13.07.2029 | Fluor Corp, Strike Price \$45.50 ^{oo} | (4.281.748) | (0,26) |
| (300.000) | 13.08.2029 | Fluor Corp, Strike Price \$45.50 ^{oo} | (4.327.153) | (0,27) |
| (200.000) | 19.01.2024 | Guardant Health Inc, Strike Price \$94.61 ^{oo} | (23) | (0,00) |
| (7) | 19.01.2024 | Hang Seng China Enterprises Index, Strike Price HKD5,800.00 [±] | (5.872) | (0,00) |
| (547) | 19.01.2024 | Hang Seng China Enterprises Index, Strike Price HKD6,900.00 [±] | (7.005) | (0,00) |
| (50.000) | 17.07.2026 | Insulet Corp, Strike Price \$225.00 ^{oo} | (3.285.596) | (0,20) |
| (28) | 11.01.2024 | KOSPI 200 Index, Strike Price KRW340.00 [±] | (109.791) | (0,01) |
| (4) | 11.01.2024 | KOSPI 200 Index, Strike Price KRW345.00 [±] | (12.773) | (0,00) |
| (23) | 11.01.2024 | KOSPI 200 Index, Strike Price KRW350.00 [±] | (53.576) | (0,00) |
| (80.000) | 15.12.2028 | Live Nation Entertainment Inc, Strike Price \$108.00 ^{oo} | (2.381.977) | (0,15) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte (23,28 %) (31. Dezember 2022: (9,90 %)) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/ Nominalwert Betrag | Fälligkeit | Art | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------------------------|------------|--|---------------|----------------------|
| Kaufsoptionen (Fortsetzung) | | | | |
| (800.000) | 19.01.2024 | Lyft Inc, Strike Price \$32.49 [∞] | (1.067) | (0,00) |
| (1.000.000) | 19.01.2024 | Lyft Inc, Strike Price \$40.00 [∞] | (426) | (0,00) |
| (180) | 19.01.2024 | Lyft Inc, Strike Price \$60.00 [±] | (540) | (0,00) |
| (91) | 19.01.2024 | Lyft Inc, Strike Price \$47.50 [±] | 0 | 0,00 |
| (283.302) | 19.01.2024 | Marriott Vacations Worldwide Corp, Strike Price \$133.17 [∞] | (1.154) | (0,00) |
| (240.000) | 19.01.2024 | Match Group Inc, Strike Price \$110.53 [∞] | (8) | (0,00) |
| (11) | 19.01.2024 | Match Group Inc, Strike Price \$115.00 [±] | 0 | 0,00 |
| (400.000) | 19.01.2024 | Match Group Inc, Strike Price \$116.99 [∞] | (9) | (0,00) |
| (350.000) | 19.01.2024 | Match Group Inc, Strike Price \$144.62 [∞] | (3) | (0,00) |
| (132) | 19.01.2024 | Match Group Inc, Strike Price \$170.00 [±] | 0 | 0,00 |
| (238) | 19.01.2024 | Match Group Inc, Strike Price \$220.00 [±] | 0 | 0,00 |
| (175) | 17.01.2025 | MetLife Inc, Strike Price \$70.00 [±] | (91.000) | (0,01) |
| (112.500) | 18.07.2025 | Middleby Corp, Strike Price \$130.00 [∞] | (4.078.606) | (0,25) |
| (200.000) | 19.01.2024 | Okta Inc, Strike Price \$172.18 [∞] | (664) | (0,00) |
| (250.000) | 19.01.2024 | Okta Inc, Strike Price \$173.89 [∞] | (774) | (0,00) |
| (133) | 19.01.2024 | Okta Inc, Strike Price \$250.00 [±] | 0 | 0,00 |
| (446.500) | 09.02.2029 | ON Semiconductor Corp, Strike Price \$103.87 [∞] | (13.837.402) | (0,85) |
| (446.500) | 16.02.2029 | ON Semiconductor Corp, Strike Price \$103.87 [∞] | (13.872.919) | (0,85) |
| (139) | 15.03.2024 | S&P 500 E-mini Call Option on Future, Strike Price \$4,400.00 [±] | (3.051.050) | (0,19) |
| (151) | 15.03.2024 | S&P 500 E-mini Call Option on Future, Strike Price \$4,600.00 [±] | (1.979.987) | (0,12) |
| (173) | 15.03.2024 | S&P 500 E-mini Call Option on Future, Strike Price \$4,650.00 [±] | (1.913.812) | (0,12) |
| (4) | 15.03.2024 | S&P 500 E-mini Call Option on Future, Strike Price \$4,800.00 [±] | (22.850) | (0,00) |
| (3) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$3,975.00 [±] | (242.910) | (0,02) |
| (5) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,025.00 [±] | (379.950) | (0,02) |
| (7) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,050.00 [±] | (514.430) | (0,03) |
| (7) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,100.00 [±] | (479.710) | (0,03) |
| (12) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,150.00 [±] | (762.120) | (0,05) |
| (3) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,275.00 [±] | (153.465) | (0,01) |
| (10) | 21.06.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,325.00 [±] | (582.500) | (0,04) |
| (38) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,375.00 [±] | (1.565.790) | (0,10) |
| (11) | 21.06.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,375.00 [±] | (592.680) | (0,04) |
| (18) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,475.00 [±] | (563.850) | (0,03) |
| (17) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,500.00 [±] | (490.790) | (0,03) |
| (3) | 20.12.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,500.00 [±] | (173.910) | (0,01) |
| (17) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,550.00 [±] | (406.300) | (0,03) |
| (30) | 21.06.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,550.00 [±] | (1.183.350) | (0,07) |
| (1) | 18.10.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,600.00 [±] | (45.625) | (0,00) |
| (5) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,700.00 [±] | (51.525) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte (23,28 %) (31. Dezember 2022: (9,90 %)) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/ Nominalwert Betrag | Fälligkeit | Art | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------------------------|------------|--|---------------|----------------------|
| Kaufsoptionen (Fortsetzung) | | | | |
| (13) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,750.00 ± | (86.255) | (0,01) |
| (24) | 21.06.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,775.00 ± | (547.920) | (0,03) |
| (20) | 21.06.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,800.00 ± | (424.800) | (0,03) |
| (13) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,850.00 ± | (23.920) | (0,00) |
| (11) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,875.00 ± | (13.420) | (0,00) |
| (21) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,900.00 ± | (16.275) | (0,00) |
| (8) | 20.12.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,900.00 ± | (244.880) | (0,02) |
| (15) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,950.00 ± | (4.275) | (0,00) |
| (56) | 21.06.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$5,000.00 ± | (580.440) | (0,04) |
| (47) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$5,200.00 ± | (705) | (0,00) |
| (19) | 21.06.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$5,200.00 ± | (75.430) | (0,00) |
| (1) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$5,210.00 ± | (15) | (0,00) |
| (18) | 21.06.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$5,250.00 ± | (54.360) | (0,00) |
| (125) | 16.02.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$5,300.00 ± | (5.937) | (0,00) |
| (6) | 20.12.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$5,300.00 ± | (68.460) | (0,00) |
| (21) | 21.06.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$5,500.00 ± | (14.805) | (0,00) |
| (4.000) | 19.01.2024 | Sarepta Therapeutics Inc, Strike Price \$100.00 ± | (1.580.000) | (0,10) |
| (2.490) | 19.01.2024 | Sarepta Therapeutics Inc, Strike Price \$120.00 ± | (143.175) | (0,01) |
| (190) | 19.01.2024 | Sarepta Therapeutics Inc, Strike Price \$125.00 ± | (9.500) | (0,00) |
| (400.000) | 19.01.2024 | Sarepta Therapeutics Inc, Strike Price \$72.73 ∞ | (9.641.377) | (0,60) |
| (216.740) | 01.05.2028 | Seagate Technology Holdings Plc, Strike Price \$82.47 ∞ | (5.154.054) | (0,32) |
| (400.000) | 21.01.2028 | Semtech Corp, Strike Price \$37.00 ∞ | (2.815.662) | (0,17) |
| (750) | 19.07.2024 | Shift4 Payments Inc, Strike Price \$105.00 ± | (69.375) | (0,00) |
| (2.090) | 19.07.2024 | Shift4 Payments Inc, Strike Price \$67.88 ∞ | (2.989.618) | (0,18) |
| (53) | 19.01.2024 | Signet Jewelers Ltd, Strike Price \$110.00 ± | (17.225) | (0,00) |
| (894.454) | 28.02.2030 | Stem Inc, Strike Price \$7.13 ∞ | (2.125.843) | (0,13) |
| (400.000) | 19.01.2024 | Sunnova Energy International Inc, Strike Price \$33.27 ∞ | (5.369) | (0,00) |
| (127.138) | 17.07.2028 | Tetra Tech Inc, Strike Price \$196.64 ∞ | (4.556.180) | (0,28) |
| (312.085) | 21.06.2024 | T-Mobile US Inc, Strike Price \$121.54 ∞ | (12.731.105) | (0,78) |
| (180.000) | 19.01.2024 | Wayfair Inc, Strike Price \$164.89 ∞ | (108) | (0,00) |
| (160.000) | 19.01.2024 | Wayfair Inc, Strike Price \$198.27 ∞ | (27) | (0,00) |
| (200.000) | 19.01.2024 | Wayfair Inc, Strike Price \$199.22 ∞ | (32) | (0,00) |
| (15) | 19.01.2024 | Wayfair Inc, Strike Price \$320.00 ± | 0 | 0,00 |
| (818.777) | 25.10.2028 | Wayfair Inc, Strike Price \$45.80 ∞ | (33.750.071) | (2,08) |
| (249.066) | 16.10.2028 | Western Digital Corp, Strike Price \$52.20 ∞ | (5.074.562) | (0,31) |
| (120.000) | 19.10.2029 | Wolfspeed Inc, Strike Price \$120.00 ∞ | (2.083.353) | (0,13) |
| 1.000.000 | 10.02.2025 | Worst of autocallable on S&P 500® Index ("SPX"), Russell 2000® Index ("RTY"), Nasdaq-100 Index® ("NDX"), Strike Price \$1.00 ∞ | (19.996) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte (23,28 %) (31. Dezember 2022: (9,90 %)) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/ Nominalwert Betrag | Fälligkeit | Art | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------------------------|------------|--|---------------|----------------------|
| Verkaufsoptionen | | | | |
| (100) | 14.06.2024 | 3 Month SOFR Future, Strike Price \$94.50 ± | (5.625) | (0,00) |
| (20.806) | 09.09.2024 | Advanced Energy Industries Inc, Strike Price \$111.45 ∞ | (263.882) | (0,02) |
| (53.892) | 15.08.2025 | Akamai Technologies Inc, Strike Price \$104.07 ∞ | (302.947) | (0,02) |
| (33.950) | 21.08.2024 | Akamai Technologies Inc, Strike Price \$109.08 ∞ | (140.850) | (0,01) |
| (46.946) | 19.01.2024 | Apellis Pharmaceuticals Inc, Strike Price \$42.97 ∞ | (45.573) | (0,00) |
| (474.110) | 19.02.2027 | BridgeBio Pharma Inc, Strike Price \$38.73 ∞ | (5.296.378) | (0,33) |
| (126.665) | 19.01.2024 | Ceridian HCM Holding Inc, Strike Price \$105.13 ∞ | (4.768.471) | (0,29) |
| (11.700) | 20.11.2026 | Confluent Inc, Strike Price \$76.14 ∞ | (547.134) | (0,03) |
| (11.700) | 18.12.2026 | Confluent Inc, Strike Price \$76.28 ∞ | (547.813) | (0,03) |
| (11.600) | 15.01.2027 | Confluent Inc, Strike Price \$76.41 ∞ | (543.712) | (0,03) |
| (70.547) | 15.01.2027 | Conmed Corp, Strike Price \$110.88 ∞ | (1.475.496) | (0,09) |
| (1.448.995) | 20.12.2024 | Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR10.99 ∞ | (45.360) | (0,00) |
| (1.448.995) | 21.03.2025 | Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR10.99 ∞ | (93.882) | (0,01) |
| (1.448.995) | 20.12.2024 | Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR11.83 ∞ | (63.426) | (0,00) |
| (1.448.995) | 21.03.2025 | Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR11.83 ∞ | (122.799) | (0,01) |
| (103.656) | 30.10.2024 | Enovis Corp, Strike Price \$47.45 ∞ | (347.132) | (0,02) |
| (92.400) | 15.10.2027 | Envestnet Inc, Strike Price \$72.69 ∞ | (2.121.267) | (0,13) |
| (14) | 19.01.2024 | Euro Stoxx 50 Index, Strike Price EUR4,550.00 ± | (9.697) | (0,00) |
| (173.640) | 09.08.2024 | Fluor Corp, Strike Price \$36.19 ∞ | (437.033) | (0,03) |
| (29.267) | 19.01.2024 | Guardant Health Inc, Strike Price \$107.62 ∞ | (2.346.703) | (0,15) |
| (10.659) | 17.07.2026 | Insulet Corp, Strike Price \$321.48 ∞ | (1.129.954) | (0,07) |
| (57) | 11.01.2024 | KOSPI 200 Index, Strike Price KRW340.00 ± | (4.315) | (0,00) |
| (33) | 11.01.2024 | KOSPI 200 Index, Strike Price KRW350.00 ± | (8.840) | (0,00) |
| (14) | 11.01.2024 | KOSPI 200 Index, Strike Price KRW355.00 ± | (7.202) | (0,00) |
| (11) | 08.02.2024 | KOSPI 200 Index, Strike Price KRW360.00 ± | (15.758) | (0,00) |
| (12.952) | 15.12.2028 | Live Nation Entertainment Inc, Strike Price \$101.56 ∞ | (279.786) | (0,02) |
| (168.821) | 19.01.2024 | Lyft Inc, Strike Price \$41.56 ∞ | (4.460.627) | (0,28) |
| (214.527) | 19.01.2024 | Lyft Inc, Strike Price \$56.35 ∞ | (8.829.312) | (0,54) |
| (78.605) | 19.01.2024 | Marriott Vacations Worldwide Corp, Strike Price \$148.83 ∞ | (4.985.510) | (0,30) |
| (76.632) | 19.01.2024 | Match Group Inc, Strike Price \$125.67 ∞ | (6.796.674) | (0,42) |
| (124.502) | 19.01.2024 | Match Group Inc, Strike Price \$132.97 ∞ | (11.947.871) | (0,73) |
| (103.560) | 19.01.2024 | Match Group Inc, Strike Price \$163.96 ∞ | (13.135.585) | (0,81) |
| (175) | 17.01.2025 | MetLife Inc, Strike Price \$65.00 ± | (95.375) | (0,01) |
| (45.713) | 18.07.2025 | Middleby Corp, Strike Price \$150.83 ∞ | (775.376) | (0,05) |
| (49.339) | 19.01.2024 | Okta Inc, Strike Price \$220.35 ∞ | (6.366.855) | (0,39) |
| (64.205) | 19.01.2024 | Okta Inc, Strike Price \$222.80 ∞ | (8.441.925) | (0,52) |
| (151.810) | 28.02.2024 | ON Semiconductor Corp, Strike Price \$82.83 ∞ | (795.922) | (0,05) |
| (75.000) | 21.11.2025 | Palo Alto Networks Inc, Strike Price \$193.96 ∞ | (1.033.026) | (0,06) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte (23,28 %) (31. Dezember 2022: (9,90 %)) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/ Nominalwert Betrag | Fälligkeit | Art | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------------|------------|---|---------------|----------------------|
| Verkaufsoptionen (Fortsetzung) | | | | |
| (750.000) | 16.05.2025 | Palo Alto Networks Inc, Strike Price \$99.20 ^{oo} | (1.167.145) | (0,07) |
| (122) | 17.07.2024 | POSCO Holdings Inc, Strike Price KRW488,000.00 ^{oo} | (4.256) | (0,00) |
| (118) | 31.01.2024 | S&P 500 E-mini Put Option on Future, Strike Price \$4,100.00 [±] | (10.325) | (0,00) |
| (73) | 19.01.2024 | S&P 500 E-mini Put Option on Future, Strike Price \$4,670.00 [±] | (36.500) | (0,00) |
| (3) | 19.01.2024 | S&P 500 E-mini Put Option on Future, Strike Price \$4,830.00 [±] | (7.650) | (0,00) |
| (12) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$2,550.00 [±] | (72) | (0,00) |
| (10) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$3,000.00 [±] | (100) | (0,00) |
| (54) | 21.06.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$3,025.00 [±] | (38.070) | (0,00) |
| (78) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$3,050.00 [±] | (780) | (0,00) |
| (45) | 21.06.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$3,050.00 [±] | (32.625) | (0,00) |
| (20) | 20.12.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$3,100.00 [±] | (48.400) | (0,00) |
| (131) | 21.06.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$3,175.00 [±] | (112.005) | (0,01) |
| (18) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$3,375.00 [±] | (360) | (0,00) |
| (19) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$3,425.00 [±] | (475) | (0,00) |
| (22) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$3,450.00 [±] | (550) | (0,00) |
| (23) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$3,475.00 [±] | (575) | (0,00) |
| (24) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$3,525.00 [±] | (720) | (0,00) |
| (7) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$3,625.00 [±] | (280) | (0,00) |
| (37) | 21.06.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$3,675.00 [±] | (63.455) | (0,00) |
| (75) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$3,725.00 [±] | (3.750) | (0,00) |
| (30) | 21.06.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$3,725.00 [±] | (55.500) | (0,00) |
| (15) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$3,750.00 [±] | (825) | (0,00) |
| (14) | 20.12.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$3,800.00 [±] | (83.090) | (0,01) |
| (87) | 21.06.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$3,875.00 [±] | (205.320) | (0,01) |
| (11) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$3,975.00 [±] | (935) | (0,00) |
| (11) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,025.00 [±] | (1.045) | (0,00) |
| (14) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,050.00 [±] | (1.400) | (0,00) |
| (12) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,100.00 [±] | (1.320) | (0,00) |
| (8) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,150.00 [±] | (960) | (0,00) |
| (1) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,265.00 [±] | (153) | (0,00) |
| (4) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,275.00 [±] | (620) | (0,00) |
| (20) | 21.06.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,325.00 [±] | (107.400) | (0,01) |
| (37) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,375.00 [±] | (7.400) | (0,00) |
| (16) | 21.06.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,375.00 [±] | (94.960) | (0,01) |
| (51) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,425.00 [±] | (11.985) | (0,00) |
| (1) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,435.00 [±] | (247) | (0,00) |
| (1) | 18.10.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,500.00 [±] | (12.525) | (0,00) |
| (9) | 20.12.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,500.00 [±] | (137.925) | (0,01) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte (23,28 %) (31. Dezember 2022: (9,90 %)) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/ Nominalwert Betrag | Fälligkeit | Art | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|---|------------|--|----------------------|----------------------|
| Verkaufsoptionen (Fortsetzung) | | | | |
| (39) | 21.06.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,550.00 ± | (331.890) | (0,02) |
| (48.561) | 19.01.2024 | Sarepta Therapeutics Inc, Strike Price \$82.73 ∞ | (45.362) | (0,00) |
| (36.846) | 09.09.2024 | Seagate Technology Holdings Plc, Strike Price \$64.30 ∞ | (83.568) | (0,01) |
| (58.277) | 21.01.2028 | Semtech Corp, Strike Price \$41.74 ∞ | (1.167.564) | (0,07) |
| (1.050) | 21.06.2024 | Shift4 Payments Inc, Strike Price \$66.42 ∞ | (520.423) | (0,03) |
| (1.050) | 19.07.2024 | Shift4 Payments Inc, Strike Price \$66.42 ∞ | (567.981) | (0,04) |
| (1.050) | 16.08.2024 | Shift4 Payments Inc, Strike Price \$66.42 ∞ | (611.055) | (0,04) |
| (49.453) | 11.01.2024 | SK Hynix Inc, Strike Price KRW88,200.00 ∞ | (0) | (0,00) |
| (89.445) | 01.04.2024 | Stem Inc, Strike Price \$5.87 ∞ | (192.191) | (0,01) |
| (67.492) | 19.01.2024 | Sunnova Energy International Inc, Strike Price \$37.85 ∞ | (1.516.909) | (0,09) |
| (34.900) | 19.08.2024 | Tetra Tech Inc, Strike Price \$165.63 ∞ | (395.576) | (0,02) |
| (400.000) | 21.06.2024 | T-Mobile US Inc, Strike Price \$115.88 ∞ | (207.835) | (0,01) |
| (41.564) | 19.01.2024 | Wayfair Inc, Strike Price \$210.42 ∞ | (6.154.805) | (0,38) |
| (37.717) | 19.01.2024 | Wayfair Inc, Strike Price \$252.89 ∞ | (7.181.038) | (0,44) |
| (49.550) | 19.01.2024 | Wayfair Inc, Strike Price \$253.24 ∞ | (9.451.231) | (0,58) |
| (114.629) | 13.05.2024 | Wayfair Inc, Strike Price \$38.47 ∞ | (231.318) | (0,01) |
| (41.096) | 07.11.2024 | Western Digital Corp, Strike Price \$42.46 ∞ | (102.352) | (0,01) |
| (21.739) | 19.10.2029 | Wolfspeed Inc, Strike Price \$107.31 ∞ | (1.355.828) | (0,08) |
| Beizulegender Zeitwert aus verkauften Optionskontrakten insgesamt * (Prämie: 504.667.233 US\$) | | | (378.717.224) | (23,28) |

Die Gegenparteien von OTC-Optionskontrakten sind Goldman Sachs International und JPMorgan Chase Bank.

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %))

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|--------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 36.562 | 10X Genomics Inc Class A | Morgan Stanley | (17.160) | (0,00) |
| (6.925) | 4D Molecular Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (3.265) | (0,00) |
| (295.384) | 89bio Inc | Morgan Stanley | (112.920) | (0,01) |
| 2.169 | A10 Networks Inc | Morgan Stanley | (259) | (0,00) |
| 1.351 | AAR Corp | Morgan Stanley | (12.516) | (0,00) |
| (10.472) | Abbott Laboratories | Morgan Stanley | (22.101) | (0,00) |
| 19.815 | Abbott Laboratories | JPMorgan Chase Bank | (3.526) | (0,00) |
| 963.129 | Abbott Laboratories | Goldman Sachs International | (46.860) | (0,01) |
| 999 | Abercrombie & Fitch Co Class A | Morgan Stanley | (2.488) | (0,00) |
| 388.275 | ABN AMRO Bank NV | Goldman Sachs International | (41.153) | (0,01) |
| (34) | Academy Sports & Outdoors Inc | Morgan Stanley | (0) | (0,00) |
| 54.681 | Acadia Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs International | (24.822) | (0,00) |
| 3.506 | Acadia Pharmaceuticals Inc | JPMorgan Chase Bank | (404) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|-------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 202.771 | Accenture Plc Class A | Goldman Sachs International | (16.622) | (0,00) |
| 117.191 | Accenture Plc Class A | Morgan Stanley | (32.574) | (0,00) |
| 94.063 | Accenture Plc Class A | JPMorgan Chase Bank | (5.662) | (0,00) |
| 208.123 | Acciona SA | Goldman Sachs International | (27.167) | (0,00) |
| (1.382) | Accolade Inc | Morgan Stanley | (1.226) | (0,00) |
| (7.358) | ACM Research Inc Class A | Morgan Stanley | (9.941) | (0,00) |
| 407.489 | Acuity Brands Inc | JPMorgan Chase Bank | (27.687) | (0,00) |
| 349.066 | Acuity Brands Inc | Goldman Sachs International | (81.219) | (0,01) |
| 594.234 | Acushnet Holdings Corp | Morgan Stanley | (67.441) | (0,01) |
| (1.302) | ACV Auctions Inc Class A | Morgan Stanley | (545) | (0,00) |
| (4.898) | AdaptHealth Corp | Morgan Stanley | (2.206) | (0,00) |
| 132.922 | Addus HomeCare Corp | Goldman Sachs International | (21.202) | (0,00) |
| 1.194 | Adecoagro S.A. | Morgan Stanley | (32) | (0,00) |
| (2.373) | Adeia Inc | Morgan Stanley | (367) | (0,00) |
| (850.214) | Adidas AG | Goldman Sachs International | (5.042) | (0,00) |
| 692 | Adobe Inc | Morgan Stanley | (3.193) | (0,00) |
| (467) | ADT Inc | Morgan Stanley | (0) | (0,00) |
| 2.137 | Adtalem Global Education Inc | Morgan Stanley | (2.156) | (0,00) |
| (2.015) | ADTRAN Holdings Inc | Morgan Stanley | (608) | (0,00) |
| 410.037 | Advance Auto Parts Inc | Morgan Stanley | (58.557) | (0,01) |
| (4.969) | Advanced Micro Devices Inc | Morgan Stanley | (47.895) | (0,00) |
| 637 | AECOM | Morgan Stanley | (74) | (0,00) |
| 393 | AerCap Holdings NV | Morgan Stanley | (44) | (0,00) |
| 39 | Affiliated Managers Group Inc | Morgan Stanley | (4) | (0,00) |
| 33.769 | Affirm Holdings Inc | Morgan Stanley | (26.502) | (0,00) |
| 67.329 | Aflac Inc | Morgan Stanley | (7.373) | (0,00) |
| 218 | AGCO Corp | Morgan Stanley | (226) | (0,00) |
| 45.456 | Agilent Technologies Inc | Goldman Sachs International | (10.032) | (0,00) |
| 59.740 | Agilent Technologies Inc | JPMorgan Chase Bank | (11.484) | (0,00) |
| (14.689) | Agilon Health Inc | Morgan Stanley | (106) | (0,00) |
| 603 | Agilysys Inc | Morgan Stanley | (385) | (0,00) |
| (2.741) | Agnico Eagle Mines Ltd | Morgan Stanley | (127) | (0,00) |
| (2.253) | Agree Realty Corp | Morgan Stanley | (990) | (0,00) |
| (821) | Air Lease Corp | Morgan Stanley | (315) | (0,00) |
| 57.071 | Airbnb Inc Class A | Goldman Sachs International | (1.985) | (0,00) |
| 1.569.322 | Airbnb Inc Class A | JPMorgan Chase Bank | (118.577) | (0,01) |
| 74.472 | Akamai Technologies Inc | Morgan Stanley | (1.689) | (0,00) |
| (2.512) | Akero Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (2.971) | (0,00) |
| 558 | Alamos Gold Inc Class A | Morgan Stanley | (263) | (0,00) |
| 715 | Alaska Air Group Inc | Morgan Stanley | (512) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|--|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 74.627 | Albemarle Corp | JPMorgan Chase Bank | (126) | (0,00) |
| 1.179 | Alcoa Corp | Morgan Stanley | (539) | (0,00) |
| (95.321) | Alcon Inc | JPMorgan Chase Bank | (5.167) | (0,00) |
| (80.769) | Alcon Inc | Goldman Sachs International | (2.646) | (0,00) |
| (30.972) | Alcon Inc | Morgan Stanley | (1.009) | (0,00) |
| 66.092 | Alexandria Real Estate Equities Inc | Morgan Stanley | (19.935) | (0,00) |
| (95.558) | Alibaba Group Holding Ltd | Morgan Stanley | (13.462) | (0,00) |
| 60.470 | Align Technology Inc | Goldman Sachs International | (1.774) | (0,00) |
| 160.994 | Alimentation Couche-Tard Inc | JPMorgan Chase Bank | (3.329) | (0,00) |
| (57.648) | Alkermes Plc | Goldman Sachs International | (3.900) | (0,00) |
| (57.732) | Alkermes Plc | JPMorgan Chase Bank | (6.712) | (0,00) |
| 1.063.122 | Allegion Plc | JPMorgan Chase Bank | (24.222) | (0,00) |
| (1.676) | Allegion Plc | Morgan Stanley | (5.985) | (0,00) |
| 938 | Allegro MicroSystems Inc | Morgan Stanley | (65) | (0,00) |
| 222.123 | Allegro.eu SA | Goldman Sachs International | (193) | (0,00) |
| 896.125 | Allegro.eu SA | JPMorgan Chase Bank | (35.460) | (0,01) |
| 67.709 | Alliant Energy Corp | Morgan Stanley | (7.640) | (0,00) |
| 60.744 | Allstate Corp | Morgan Stanley | (15.973) | (0,00) |
| (2.026) | Ally Financial Inc | Morgan Stanley | (939) | (0,00) |
| (367) | Alnylam Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (3.810) | (0,00) |
| 257.624 | Alnylam Pharmaceuticals Inc | JPMorgan Chase Bank | (18.281) | (0,00) |
| 186.063 | Alnylam Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs International | (17.486) | (0,00) |
| (220) | Alpha & Omega Semiconductor Ltd | Morgan Stanley | (98) | (0,00) |
| 40.487 | Alphabet Inc Class A | JPMorgan Chase Bank | (981) | (0,00) |
| (2.856) | Alphabet Inc Class A | Morgan Stanley | (331) | (0,00) |
| 180.923 | Alphabet Inc Class C | JPMorgan Chase Bank | (13.159) | (0,00) |
| (208) | Altair Engineering Inc Class A | Morgan Stanley | (1.973) | (0,00) |
| 2.678 | Alteryx Inc Class A | Morgan Stanley | (167) | (0,00) |
| 570 | Altria Group Inc | Morgan Stanley | (163) | (0,00) |
| (4.425) | A-Mark Precious Metals Inc | Morgan Stanley | (165) | (0,00) |
| (185.689) | Amazon.com Inc | JPMorgan Chase Bank | (938) | (0,00) |
| (102.425) | Amazon.com Inc | Morgan Stanley | (4.783) | (0,00) |
| 28 | Ambarella Inc | Morgan Stanley | (46) | (0,00) |
| (77.740) | AMC Entertainment Holdings Inc Class A | Morgan Stanley | (13.110) | (0,00) |
| (1.180) | Amcor Plc | Morgan Stanley | (1) | (0,00) |
| (752) | Amdocs Ltd | Morgan Stanley | (64) | (0,00) |
| 67.081 | Ameren Corp | Morgan Stanley | (1.291) | (0,00) |
| (511.036) | American Airlines Group Inc | JPMorgan Chase Bank | (7.131) | (0,00) |
| (155.302) | American Airlines Group Inc | Goldman Sachs International | (3.696) | (0,00) |
| (37.919) | American Airlines Group Inc | Morgan Stanley | (3.699) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|--------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 561.351 | American Eagle Outfitters Inc | Morgan Stanley | (109.675) | (0,01) |
| 448.861 | American Eagle Outfitters Inc | JPMorgan Chase Bank | (16.170) | (0,00) |
| (1.210) | American Electric Power Co Inc | Morgan Stanley | (916) | (0,00) |
| 66.060 | American Express Co | Morgan Stanley | (17.234) | (0,00) |
| 3.266 | American Homes 4 Rent Class A | Morgan Stanley | (151) | (0,00) |
| 748 | American States Water Co | Morgan Stanley | (1.404) | (0,00) |
| (1.020) | American Tower Corp | Morgan Stanley | (2.739) | (0,00) |
| 3.722 | American Vanguard Corp | Morgan Stanley | (273) | (0,00) |
| 41.564 | Americold Realty Trust Inc | Morgan Stanley | (2.794) | (0,00) |
| (5) | AMETEK Inc | Morgan Stanley | (0) | (0,00) |
| 267.597 | Amgen Inc | JPMorgan Chase Bank | (3.063) | (0,00) |
| 53.238 | Amgen Inc | Goldman Sachs International | (435) | (0,00) |
| 14.964 | Amicus Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (4.834) | (0,00) |
| 25.622 | Amicus Therapeutics Inc | Goldman Sachs International | (4.293) | (0,00) |
| 8.774 | Amicus Therapeutics Inc | JPMorgan Chase Bank | (3.783) | (0,00) |
| 75.724 | AMN Healthcare Services Inc | Goldman Sachs International | (890) | (0,00) |
| (350) | AMN Healthcare Services Inc | Morgan Stanley | (412) | (0,00) |
| 159.179 | Amphenol Corp Class A | Morgan Stanley | (35.040) | (0,00) |
| 188 | Amplitude Inc Class A | Morgan Stanley | (51) | (0,00) |
| 10.581 | Amplitude Inc Class A | Goldman Sachs International | (612) | (0,00) |
| 35.916 | Amplitude Inc Class A | JPMorgan Chase Bank | (1.318) | (0,00) |
| 65.445 | Analog Devices Inc | Morgan Stanley | (29.740) | (0,00) |
| 77.917 | Anheuser-Busch InBev SA | Goldman Sachs International | (12.869) | (0,00) |
| 431.353 | Anheuser-Busch InBev SA | JPMorgan Chase Bank | (58.075) | (0,01) |
| 68.074 | Annaly Capital Management Inc | Morgan Stanley | (8.308) | (0,00) |
| 72.977 | ANSYS Inc | Morgan Stanley | (64.078) | (0,01) |
| (79.252) | Antero Midstream Corp | Morgan Stanley | (4.063) | (0,00) |
| (311.371) | Antero Resources Corp | JPMorgan Chase Bank | (12.491) | (0,00) |
| 31.274 | Apellis Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (19.345) | (0,00) |
| (5.601) | API Group Corp | Morgan Stanley | (3.304) | (0,00) |
| 79.224 | Apogee Therapeutics Inc | JPMorgan Chase Bank | (35.756) | (0,01) |
| (3.471) | Apollo Global Management Inc | Morgan Stanley | (1.591) | (0,00) |
| (721) | Apollo Medical Holdings Inc | Morgan Stanley | (1.062) | (0,00) |
| (498) | Appfolio Inc Class A | Morgan Stanley | (5.307) | (0,00) |
| (47.871) | Appfolio Inc Class A | JPMorgan Chase Bank | (1.883) | (0,00) |
| 74.020 | Apple Inc | Goldman Sachs International | (1.250) | (0,00) |
| 197.832 | Apple Inc | JPMorgan Chase Bank | (17.448) | (0,00) |
| (458) | Applied Materials Inc | Morgan Stanley | (532) | (0,00) |
| 3.117 | AppLovin Corp Class A | Morgan Stanley | (11.882) | (0,00) |
| 16.570 | Aptargroup Inc | Morgan Stanley | (229) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|---|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| (977) | Aptiv Plc | Morgan Stanley | (1.121) | (0,00) |
| 67.346 | Aramark | Morgan Stanley | (4.506) | (0,00) |
| 52.628 | Arcellx Inc | JPMorgan Chase Bank | (4.543) | (0,00) |
| 60.994 | Arcellx Inc | Goldman Sachs International | (8.330) | (0,00) |
| (6.000) | Arch Capital Group Ltd | Morgan Stanley | (2.259) | (0,00) |
| (239) | Arch Resources Inc | Morgan Stanley | (453) | (0,00) |
| 2.908 | Archer Aviation Inc Class A | Morgan Stanley | (841) | (0,00) |
| 378.048 | Archer-Daniels-Midland Co | JPMorgan Chase Bank | (4.048) | (0,00) |
| 167 | Arcos Dorados Holdings Inc Class A | Morgan Stanley | (18) | (0,00) |
| (2.340) | Arcus Biosciences Inc | Morgan Stanley | (1.721) | (0,00) |
| (22.362) | Arcus Biosciences Inc | JPMorgan Chase Bank | (1.837) | (0,00) |
| 680 | Ares Commercial Real Estate Corp | Morgan Stanley | (434) | (0,00) |
| (1.969) | Ares Management Corp Class A | Morgan Stanley | (4.962) | (0,00) |
| 62.310 | Arista Networks Inc | Morgan Stanley | (17.240) | (0,00) |
| 4.660 | Arlo Technologies Inc | Morgan Stanley | (18) | (0,00) |
| (2.531) | ARMOUR Residential REIT Inc | Morgan Stanley | (286) | (0,00) |
| (1.167) | Arrowhead Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (2.533) | (0,00) |
| (4.741) | ARS Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (1.595) | (0,00) |
| 63.692 | Arthur J Gallagher & Co | Morgan Stanley | (15.197) | (0,00) |
| (101) | Artisan Partners Asset Management Inc Class A | Morgan Stanley | (0) | (0,00) |
| (518) | Arvinas Inc | Morgan Stanley | (2.160) | (0,00) |
| 290 | Asana Inc Class A | Morgan Stanley | (65) | (0,00) |
| (100) | Asbury Automotive Group Inc | Morgan Stanley | (121) | (0,00) |
| 42.264 | Ashland Inc | Morgan Stanley | (3.224) | (0,00) |
| 55.855 | ASML Holding NV | Morgan Stanley | (8.398) | (0,00) |
| (550) | Aspen Aerogels Inc | Morgan Stanley | (984) | (0,00) |
| 79.039 | Aspen Technology Inc | Morgan Stanley | (14.493) | (0,00) |
| 47.858 | Assicurazioni Generali | Goldman Sachs International | (772) | (0,00) |
| 65.447 | Assurant Inc | Morgan Stanley | (11.096) | (0,00) |
| 139.988 | AstraZeneca Plc | JPMorgan Chase Bank | (12.887) | (0,00) |
| 511.419 | AstraZeneca Plc | Goldman Sachs International | (30.431) | (0,00) |
| 8.327 | AT&T Inc | Goldman Sachs International | (146) | (0,00) |
| 57.543 | AT&T Inc | JPMorgan Chase Bank | (5.230) | (0,00) |
| 310 | ATI Inc | Morgan Stanley | (4) | (0,00) |
| 30.493 | Atlassian Corp Class A | Morgan Stanley | (7.405) | (0,00) |
| 64.536 | Atmos Energy Corp | Morgan Stanley | (13.706) | (0,00) |
| (3.867) | Aurora Innovation Inc | Morgan Stanley | (279) | (0,00) |
| 115.289 | Autodesk Inc | Morgan Stanley | (14.438) | (0,00) |
| 118.256 | Automatic Data Processing Inc | JPMorgan Chase Bank | (5.616) | (0,00) |
| (131.947) | Automatic Data Processing Inc | Morgan Stanley | (1.911) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|-------------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 35.612 | Automatic Data Processing Inc | Goldman Sachs International | (344) | (0,00) |
| (151) | AutoNation Inc | Morgan Stanley | (46) | (0,00) |
| 70.566 | AutoZone Inc | Morgan Stanley | (1.803) | (0,00) |
| 71.137 | Avalonbay Communities Inc | Morgan Stanley | (6.703) | (0,00) |
| 40.629 | Avangrid Inc | Morgan Stanley | (5.873) | (0,00) |
| 66.773 | Avantor Inc | Morgan Stanley | (11.575) | (0,00) |
| 70.336 | Avery Dennison Corp | Morgan Stanley | (8.317) | (0,00) |
| (911) | Avid Bioservices Inc | Morgan Stanley | (91) | (0,00) |
| (11.822) | Avidity Biosciences Inc | Morgan Stanley | (4.662) | (0,00) |
| 23.979 | AvidXchange Holdings Inc | JPMorgan Chase Bank | (7.196) | (0,00) |
| (635) | Avista Corp | Morgan Stanley | (361) | (0,00) |
| (1.055) | Avnet Inc | Morgan Stanley | (896) | (0,00) |
| 228 | Axcelis Technologies Inc | Morgan Stanley | (445) | (0,00) |
| (85.339) | Axis Capital Holdings Ltd | Morgan Stanley | (820) | (0,00) |
| (90) | Axonics Inc | Morgan Stanley | (257) | (0,00) |
| (2.343) | Axsome Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (19.342) | (0,00) |
| 34.994 | AZEK Co Inc | Morgan Stanley | (12.853) | (0,00) |
| 32.813 | Azenta Inc | Morgan Stanley | (15.164) | (0,00) |
| (270) | AZZ Inc | Morgan Stanley | (943) | (0,00) |
| 1.334.686 | B3 SA - Brasil Bolsa Balca | Goldman Sachs International | (12.764) | (0,00) |
| 3.157 | Baker Hughes Co | Morgan Stanley | (143) | (0,00) |
| (729.167) | Baker Hughes Co | Goldman Sachs International | (1.960) | (0,00) |
| (288.914) | Baker Hughes Co | JPMorgan Chase Bank | (8.643) | (0,00) |
| 65.976 | Ball Corp | Morgan Stanley | (11.456) | (0,00) |
| 101.554 | Banca Generali SpA | Goldman Sachs International | (7.740) | (0,00) |
| (80.073) | Banca Monte dei Paschi di Siena SpA | Goldman Sachs International | (3.574) | (0,00) |
| 520.610 | Banco BTG Pactual SA | Goldman Sachs International | (4.250) | (0,00) |
| 587.685 | Banco Do Brasil SA | Goldman Sachs International | (6.624) | (0,00) |
| 918.750 | Banco Santander | Goldman Sachs International | (24.229) | (0,00) |
| (312.742) | Banco Santander SA | Goldman Sachs International | (14.312) | (0,00) |
| 219 | Bancorp Inc | Morgan Stanley | (606) | (0,00) |
| 6.014 | Bank of America Corp | Morgan Stanley | (763) | (0,00) |
| (100.902) | Bank Of Ireland Group Plc | Goldman Sachs International | (4.523) | (0,00) |
| (12.847) | Bank of New York Mellon Corp | Morgan Stanley | (8.637) | (0,00) |
| (4.500) | Bank of Nova Scotia | Morgan Stanley | (4.169) | (0,00) |
| 2.948 | Bank OZK | Morgan Stanley | (1.647) | (0,00) |
| (181.030) | Bankinter SA | Goldman Sachs International | (14.728) | (0,00) |
| (660) | Barrick Gold Corp | Morgan Stanley | (8) | (0,00) |
| 520.915 | Bath & Body Works Inc | JPMorgan Chase Bank | (900) | (0,00) |
| (75.842) | Baxter International Inc | Morgan Stanley | (11.293) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|---------------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 959.082 | Baxter International Inc | Goldman Sachs International | (23.128) | (0,00) |
| 729.267 | BB Seguridade Participacoes SA | Goldman Sachs International | (11.616) | (0,00) |
| 2.030 | Beacon Roofing Supply Inc | Morgan Stanley | (1.054) | (0,00) |
| 89.833 | Beam Therapeutics Inc | JPMorgan Chase Bank | (9.436) | (0,00) |
| 1.625 | Becton Dickinson & Co | Goldman Sachs International | (75) | (0,00) |
| (703) | Becton Dickinson & Co | Morgan Stanley | (1.709) | (0,00) |
| (157.649) | BeiGene Ltd | Goldman Sachs International | (13.802) | (0,00) |
| (62.815) | BeiGene Ltd | JPMorgan Chase Bank | (10.084) | (0,00) |
| 891 | BellRing Brands Inc | Morgan Stanley | (206) | (0,00) |
| 63.128 | Bentley Systems Inc Class B | Morgan Stanley | (6.637) | (0,00) |
| (1.221) | Berkshire Hathaway Inc | Morgan Stanley | (124) | (0,00) |
| 256 | Berkshire Hills Bancorp Inc | Morgan Stanley | (71) | (0,00) |
| 796.280 | Best Buy Co Inc | Morgan Stanley | (60.366) | (0,01) |
| 511.147 | Best Buy Co Inc | JPMorgan Chase Bank | (27.881) | (0,00) |
| (1.134) | Beyond Inc | Morgan Stanley | (2.454) | (0,00) |
| (172) | BGC Group Inc Class A | Morgan Stanley | (22) | (0,00) |
| 5.552.198 | Bid Corp Ltd | Goldman Sachs International | (6.958) | (0,00) |
| 3.575.012 | Bid Corp Ltd | JPMorgan Chase Bank | (8.241) | (0,00) |
| 8.946 | Bill.com Holdings Inc | Morgan Stanley | (1.772) | (0,00) |
| 67.156 | Biogen Inc | Goldman Sachs International | (9.402) | (0,00) |
| 95.076 | Biogen Inc | JPMorgan Chase Bank | (8.032) | (0,00) |
| (503) | Biogen Inc | Morgan Stanley | (4.264) | (0,00) |
| (1.238) | Biohaven Ltd | Morgan Stanley | (5.471) | (0,00) |
| (380) | BioLife Solutions Inc | Morgan Stanley | (322) | (0,00) |
| 40.654 | BioMarin Pharmaceutical Inc | Morgan Stanley | (5.434) | (0,00) |
| 41.004 | BioMarin Pharmaceutical Inc | JPMorgan Chase Bank | (5.656) | (0,00) |
| 40.211 | BioMarin Pharmaceutical Inc | Goldman Sachs International | (5.208) | (0,00) |
| (1.069) | Biomea Fusion Inc | Morgan Stanley | (190) | (0,00) |
| (43) | Bio-Rad Laboratories Inc Class A | Morgan Stanley | (523) | (0,00) |
| 701.441 | Birkenstock Holding Plc | Morgan Stanley | (110.590) | (0,01) |
| 629.851 | BJ's Wholesale Club Holdings Inc | Goldman Sachs International | (16.572) | (0,00) |
| (392.246) | BJ's Wholesale Club Holdings Inc | Morgan Stanley | (23.797) | (0,00) |
| 688.810 | BJ's Wholesale Club Holdings Inc | JPMorgan Chase Bank | (15.787) | (0,00) |
| 3.453 | Black Hills Corp | Morgan Stanley | (2.275) | (0,00) |
| 2.710 | BlackLine Inc | Morgan Stanley | (1.486) | (0,00) |
| 60.535 | BlackRock Inc | Morgan Stanley | (20.545) | (0,00) |
| 72.718 | Blackstone Inc | Morgan Stanley | (16.189) | (0,00) |
| 727 | Blackstone Mortgage Trust Inc Class A | Morgan Stanley | (119) | (0,00) |
| 2.385 | Blackstone Secured Lending Fund | Morgan Stanley | (2) | (0,00) |
| (9.311) | Bloom Energy Corp Class A | Morgan Stanley | (6.272) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|--|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 1.602 | Blue Owl Capital Corp | Morgan Stanley | (164) | (0,00) |
| 33.693 | Blue Owl Capital Inc | Morgan Stanley | (6.945) | (0,00) |
| 21.834 | Blueprint Medicines Corp | Goldman Sachs International | (11.743) | (0,00) |
| 57.522 | Blueprint Medicines Corp | JPMorgan Chase Bank | (27.696) | (0,00) |
| (416) | Blueprint Medicines Corp | Morgan Stanley | (2.962) | (0,00) |
| 199.663 | BNP Paribas SA | Goldman Sachs International | (27.635) | (0,00) |
| 78.406 | Boeing Co | Morgan Stanley | (19.715) | (0,00) |
| 43.783 | BOK Financial Corp | Morgan Stanley | (6.245) | (0,00) |
| 734.119 | Booking Holdings Inc | Morgan Stanley | (145.343) | (0,01) |
| 100.531 | Booking Holdings Inc | Goldman Sachs International | (27.133) | (0,00) |
| (1.233.775) | Boot Barn Holdings Inc | Morgan Stanley | (47.896) | (0,01) |
| 331.936 | BorgWarner Inc | JPMorgan Chase Bank | (17.505) | (0,00) |
| 292.568 | BorgWarner Inc | Goldman Sachs International | (21.779) | (0,00) |
| 188 | BorgWarner Inc | Morgan Stanley | (22) | (0,00) |
| 206 | Boston Beer Co Inc Class A | Morgan Stanley | (449) | (0,00) |
| 64 | Boston Scientific Corp | Morgan Stanley | (6) | (0,00) |
| 9.221 | Box Inc Class A | Morgan Stanley | (4.875) | (0,00) |
| (110.630) | BPER Banca | Goldman Sachs International | (2.333) | (0,00) |
| 474 | Brady Corp Class A | Morgan Stanley | (54) | (0,00) |
| (100) | Brandywine Realty Trust | Morgan Stanley | (11) | (0,00) |
| (641) | Bridgebio Pharma Inc | Morgan Stanley | (1.044) | (0,00) |
| 39.129 | Bright Horizons Family Solutions Inc | Morgan Stanley | (5.999) | (0,00) |
| 1.706 | Brighthouse Financial Inc | Morgan Stanley | (1.069) | (0,00) |
| 4.825 | BrightSphere Investment Group Inc | Morgan Stanley | (2.384) | (0,00) |
| 4.576 | BrightSpire Capital Inc | Morgan Stanley | (1.033) | (0,00) |
| (40) | Brink's Co | Morgan Stanley | (10) | (0,00) |
| 7.931 | Bristol-Myers Squibb Co | Morgan Stanley | (72) | (0,00) |
| 3.668 | Brixmor Property Group Inc | Morgan Stanley | (440) | (0,00) |
| (283) | Broadridge Financial Solutions Inc | Morgan Stanley | (1.120) | (0,00) |
| 9 | Brookfield Corp | Morgan Stanley | (4) | (0,00) |
| 2.232 | Brookfield Infrastructure Corp Class A | Morgan Stanley | (1) | (0,00) |
| (5.840) | Brookfield Renewable Corp Class A | Morgan Stanley | (33) | (0,00) |
| 240.277 | Brookfield Renewable Corp Class A | JPMorgan Chase Bank | (70.193) | (0,01) |
| 191.652 | Brookfield Renewable Corp Class A | Goldman Sachs International | (19.691) | (0,00) |
| 70.191 | Brown & Brown Inc | Morgan Stanley | (1.672) | (0,00) |
| (175.071) | Brown-Forman Corp Class B | Morgan Stanley | (2.788) | (0,00) |
| (151.677) | Brown-Forman Corp Class B | Goldman Sachs International | (1.217) | (0,00) |
| (337.383) | Brown-Forman Corp Class B | JPMorgan Chase Bank | (6.337) | (0,00) |
| (236) | BRP Group Inc Class A | Morgan Stanley | (142) | (0,00) |
| 207 | Bruker Corp | Morgan Stanley | (6) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|----------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 40.289 | Brunswick Corp | Morgan Stanley | (10.144) | (0,00) |
| 272.880 | Brunswick Corp | JPMorgan Chase Bank | (86.757) | (0,01) |
| 535.998 | Bunge Global SA | JPMorgan Chase Bank | (34) | (0,00) |
| (2.120) | Cabaletta Bio Inc | Morgan Stanley | (2.175) | (0,00) |
| 1.174 | Cadence Design Systems Inc | Morgan Stanley | (160) | (0,00) |
| 2.021 | Caesars Entertainment Inc | Morgan Stanley | (799) | (0,00) |
| (2.948) | Cal-Maine Foods Inc | Morgan Stanley | (5.140) | (0,00) |
| 845.313 | Campbell Soup Co | Morgan Stanley | (32.902) | (0,01) |
| 199.435 | Campbell Soup Co | JPMorgan Chase Bank | (16.107) | (0,00) |
| 991 | Canada Goose Holdings Inc | Morgan Stanley | (329) | (0,00) |
| 1.441.725 | Canadian National Railway Co | JPMorgan Chase Bank | (39.586) | (0,01) |
| (1.180) | Canadian National Railway Co | Morgan Stanley | (958) | (0,00) |
| (35.196) | Canadian Natural Resources | Morgan Stanley | (613) | (0,00) |
| 668.590 | Canadian Natural Resources Ltd | JPMorgan Chase Bank | (357) | (0,00) |
| 10.380 | Canadian Natural Resources Ltd | Goldman Sachs International | (132) | (0,00) |
| 2.045 | Canadian Natural Resources Ltd | Morgan Stanley | (1.231) | (0,00) |
| 530.871 | Canadian Pacific Kansas City Ltd | Goldman Sachs International | (9.923) | (0,00) |
| 1.378.234 | Canadian Pacific Kansas City Ltd | JPMorgan Chase Bank | (29.999) | (0,00) |
| (232) | Canadian Solar Inc | Morgan Stanley | (105) | (0,00) |
| 1.934 | Capitol Federal Financial Inc | Morgan Stanley | (428) | (0,00) |
| 41.999 | Capri Holdings Ltd | Morgan Stanley | (1.086) | (0,00) |
| 466.855 | Cardinal Health Inc | Goldman Sachs International | (308) | (0,00) |
| 12.045 | CareTrust REIT Inc | Morgan Stanley | (5.582) | (0,00) |
| (52.024) | Cargurus Inc | JPMorgan Chase Bank | (632) | (0,00) |
| 67.891 | Carlisle Cos Inc | Morgan Stanley | (16.195) | (0,00) |
| 90.485 | Carlyle Group Inc | Morgan Stanley | (16.678) | (0,00) |
| (2.293) | CarMax Inc | Morgan Stanley | (1.868) | (0,00) |
| (569.107) | Carnival Corp | JPMorgan Chase Bank | (23.333) | (0,00) |
| 51.757 | Carnival Corp | Morgan Stanley | (35.680) | (0,01) |
| (12) | Carpenter Technology Corp | Morgan Stanley | (0) | (0,00) |
| 197 | Carriage Services Inc | Morgan Stanley | (25) | (0,00) |
| 295.425 | Carrier Global Corp | Goldman Sachs International | (20.074) | (0,00) |
| 152.765 | Carrier Global Corp | JPMorgan Chase Bank | (16.303) | (0,00) |
| 70.705 | Carrier Global Corp | Morgan Stanley | (10.429) | (0,00) |
| 1.400 | Carter's Inc | Morgan Stanley | (591) | (0,00) |
| 42.222 | Casey's General Stores Inc | Morgan Stanley | (728) | (0,00) |
| 309.070 | Catalent Inc | Goldman Sachs International | (33.759) | (0,01) |
| 81.061 | Catalent Inc | Morgan Stanley | (2.055) | (0,00) |
| (200) | Catalyst Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (471) | (0,00) |
| 394.843 | Caterpillar Inc | JPMorgan Chase Bank | (79.576) | (0,01) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|---------------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| (104.811) | Caterpillar Inc | Morgan Stanley | (498) | (0,00) |
| (100) | Cathay General Bancorp | Morgan Stanley | (2) | (0,00) |
| 64.687 | Cboe Global Markets Inc | Morgan Stanley | (9.356) | (0,00) |
| 83.152 | CDW Corp | Morgan Stanley | (13.744) | (0,00) |
| 109.565 | CDW Corp | JPMorgan Chase Bank | (9.479) | (0,00) |
| 94.530 | CDW Corp | Goldman Sachs International | (9.350) | (0,00) |
| 61.466 | Celanese Corp | Morgan Stanley | (30.574) | (0,00) |
| 1.110 | Celestica Inc | Morgan Stanley | (304) | (0,00) |
| (2.326) | Celldex Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (3.010) | (0,00) |
| 742 | Cellebrite DI Ltd | Morgan Stanley | (11) | (0,00) |
| (547) | Celsius Holdings Inc | Morgan Stanley | (2.290) | (0,00) |
| (41.361) | Celsius Holdings Inc | Goldman Sachs International | (2.612) | (0,00) |
| 948.339 | Cemig Cia Energetica DE Minas Gerais | Goldman Sachs International | (8.786) | (0,00) |
| (706.772) | Cenovus Energy Inc | JPMorgan Chase Bank | (72.373) | (0,01) |
| (201.412) | Cenovus Energy Inc | Morgan Stanley | (2.425) | (0,00) |
| (12.251) | Centene Corp | Morgan Stanley | (18.191) | (0,00) |
| (1.064) | CenterPoint Energy Inc | Morgan Stanley | (41) | (0,00) |
| (4.338) | Century Aluminum Co | Morgan Stanley | (1.516) | (0,00) |
| (93.209) | Ceridian HCM Holding Inc | Goldman Sachs International | (839) | (0,00) |
| (26.013) | Ceridian HCM Holding Inc | JPMorgan Chase Bank | (490) | (0,00) |
| (24.103) | Ceridian HCM Holding Inc | Morgan Stanley | (350) | (0,00) |
| 33.681 | Certara Inc | Morgan Stanley | (14.275) | (0,00) |
| 100 | CEVA Inc | Morgan Stanley | (81) | (0,00) |
| 3.561.546 | CEZ AS | Goldman Sachs International | (3.615) | (0,00) |
| (1.953) | CF Industries Holdings Inc | Morgan Stanley | (1.365) | (0,00) |
| 433 | CH Robinson Worldwide Inc | Morgan Stanley | (191) | (0,00) |
| 236 | ChampionX Corp | Morgan Stanley | (54) | (0,00) |
| (509) | Chart Industries Inc | Morgan Stanley | (2.047) | (0,00) |
| (221) | Charter Communications Inc Class A | Morgan Stanley | (762) | (0,00) |
| (732) | Check Point Software Technologies Ltd | Morgan Stanley | (597) | (0,00) |
| 136 | Cheesecake Factory Inc | Morgan Stanley | (20) | (0,00) |
| (501.550) | Cheniere Energy Inc | Morgan Stanley | (14.822) | (0,00) |
| (618.980) | Cheniere Energy Inc | JPMorgan Chase Bank | (13.115) | (0,00) |
| (1.578) | Chesapeake Energy Corp | Morgan Stanley | (1.111) | (0,00) |
| (566.667) | Chevron Corp | Goldman Sachs International | (10.327) | (0,00) |
| (570.438) | Chevron Corp | Morgan Stanley | (11.282) | (0,00) |
| (8.074) | Chewy Inc Class A | Morgan Stanley | (855) | (0,00) |
| (92.347) | Choice Hotels International Inc | Morgan Stanley | (5.315) | (0,00) |
| (237.971) | Chord Energy Corp | Goldman Sachs International | (3.344) | (0,00) |
| 63.322 | Chubb Ltd | Morgan Stanley | (37.040) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|---|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 8.642.319 | Chugai Pharmaceutical Co | Goldman Sachs International | (14.468) | (0,00) |
| 64.327 | Church & Dwight Co Inc | Morgan Stanley | (22.242) | (0,00) |
| 484.461 | Cia de Transmissao de Energia | Goldman Sachs International | (12.628) | (0,00) |
| (1.495.093) | Cia Paranaense De Energia | Goldman Sachs International | (29.537) | (0,00) |
| 89.171 | Cie Financiere Richemont SA Class A | JPMorgan Chase Bank | (12.122) | (0,00) |
| 229.724 | Cie Financiere Richemont SA Class A | Goldman Sachs International | (14.186) | (0,00) |
| (153.601) | Ciena Corp | Morgan Stanley | (2.550) | (0,00) |
| (792) | Cigna Corp | Morgan Stanley | (2.160) | (0,00) |
| 12.800 | CinCor Pharma Inc | Morgan Stanley | (19.968) | (0,00) |
| 939 | Cinemark Holdings Inc | Morgan Stanley | (210) | (0,00) |
| (337) | Cisco Systems Inc | Morgan Stanley | (123) | (0,00) |
| (7.631) | Citigroup Inc | Morgan Stanley | (7.327) | (0,00) |
| 20.282 | Clarivate Plc | Morgan Stanley | (22.474) | (0,00) |
| 42.555 | Clean Harbors Inc | Morgan Stanley | (3.772) | (0,00) |
| (22.603) | Cleanspark Inc | Morgan Stanley | (2.709) | (0,00) |
| 9.202 | Clear Secure Inc Class A | Morgan Stanley | (10.463) | (0,00) |
| (2.437) | Clearfield Inc | Morgan Stanley | (1.238) | (0,00) |
| 84.009 | Clorox Co | Goldman Sachs International | (237) | (0,00) |
| 21.285 | Cloudflare Inc Class A | Morgan Stanley | (7.300) | (0,00) |
| 9.289 | Cloudflare Inc Class A | JPMorgan Chase Bank | (5.024) | (0,00) |
| 69.466 | CMS Energy Corp | Morgan Stanley | (5.467) | (0,00) |
| 38.740 | CNH Industrial NV | Morgan Stanley | (5.868) | (0,00) |
| (7.099) | CNX Resources Corp | JPMorgan Chase Bank | (335) | (0,00) |
| 298.871 | Coca-Cola Co | Goldman Sachs International | (11.344) | (0,00) |
| 268.308 | Coca-Cola Co | JPMorgan Chase Bank | (11.957) | (0,00) |
| (7.476) | Coca-Cola Europacific Partners Plc | Morgan Stanley | (12.661) | (0,00) |
| 5.391 | Coeur Mining Inc | Morgan Stanley | (1.461) | (0,00) |
| (9.961) | Cogent Biosciences Inc | Morgan Stanley | (6.520) | (0,00) |
| (380) | Cogent Communications Holdings Inc | Morgan Stanley | (1.366) | (0,00) |
| 73.329 | Cognex Corp | Morgan Stanley | (8.151) | (0,00) |
| 37.737 | Cognizant Technology Solutions Corp Class A | Morgan Stanley | (2.079) | (0,00) |
| 28.664 | Coherent Corp | Morgan Stanley | (5.284) | (0,00) |
| 522.955 | Colgate-Palmolive Co | Goldman Sachs International | (15.264) | (0,00) |
| 93.225 | Colgate-Palmolive Co | JPMorgan Chase Bank | (2.014) | (0,00) |
| (2.604) | Colgate-Palmolive Co | Morgan Stanley | (2.216) | (0,00) |
| 38.601 | Columbia Sportswear Co | Morgan Stanley | (4.831) | (0,00) |
| 2.505 | Comcast Corp Class A | Morgan Stanley | (1.563) | (0,00) |
| 85.557 | Comcast Corp Class A | JPMorgan Chase Bank | (6.056) | (0,00) |
| 37.409 | Commerce Bancshares Inc | Morgan Stanley | (8.764) | (0,00) |
| 53.798 | Commerzbank AG | Goldman Sachs International | (829) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|--------------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 1.379 | Community Health Systems Inc | Morgan Stanley | (99) | (0,00) |
| 272 | Community Healthcare Trust Inc | Morgan Stanley | (117) | (0,00) |
| (3.577) | Compass Inc Class A | JPMorgan Chase Bank | (64) | (0,00) |
| 2.284 | Compass Minerals International Inc | Morgan Stanley | (2.087) | (0,00) |
| (10.964) | Comstock Resources Inc | Morgan Stanley | (712) | (0,00) |
| 48.115 | Conagra Brands Inc | Morgan Stanley | (7.946) | (0,00) |
| (28.742) | Confluent Inc Class A | JPMorgan Chase Bank | (5.155) | (0,00) |
| 1.754 | Consensus Cloud Solutions Inc | Morgan Stanley | (1.852) | (0,00) |
| 207.689 | CONSOL Energy Inc | JPMorgan Chase Bank | (5.902) | (0,00) |
| (121) | CONSOL Energy Inc | Morgan Stanley | (7) | (0,00) |
| (1.150) | Consolidated Edison Inc | Morgan Stanley | (1.190) | (0,00) |
| (373.282) | Constellation Brands Inc Class A | JPMorgan Chase Bank | (27.565) | (0,00) |
| (3.123.690) | Constellation Brands Inc Class A | Morgan Stanley | (143.687) | (0,01) |
| 64.632 | Constellation Energy Corp | Morgan Stanley | (7.858) | (0,00) |
| (239) | Constellium SE | Morgan Stanley | (47) | (0,00) |
| 236 | Construction Partners Inc Class A | Morgan Stanley | (127) | (0,00) |
| (4.300) | Contra Abiomed Inc | Morgan Stanley | (3.139) | (0,00) |
| (48.286) | Cooper Cos Inc | Goldman Sachs International | (1.106) | (0,00) |
| 26.346 | Copart Inc | JPMorgan Chase Bank | (4.337) | (0,00) |
| 55.220 | Copart Inc | Morgan Stanley | (13.228) | (0,00) |
| 34.136 | Core & Main Inc Class A | Morgan Stanley | (14.614) | (0,00) |
| (1.161) | CoreCivic Inc | Morgan Stanley | (235) | (0,00) |
| 31.583 | Corning Inc | Morgan Stanley | (23.420) | (0,00) |
| (2.366) | Costamare Inc | Morgan Stanley | (551) | (0,00) |
| 65.550 | CoStar Group Inc | Morgan Stanley | (10.951) | (0,00) |
| (526.103) | Coterra Energy Inc | JPMorgan Chase Bank | (15.474) | (0,00) |
| (6.505) | Coterra Energy Inc | Morgan Stanley | (144) | (0,00) |
| (32.533) | Coty Inc | Morgan Stanley | (978) | (0,00) |
| 218.734 | Coty Inc Class A | Goldman Sachs International | (12.087) | (0,00) |
| 34.916 | Coty Inc Class A | Morgan Stanley | (8.092) | (0,00) |
| 159.972 | Coty Inc Class A | JPMorgan Chase Bank | (7.388) | (0,00) |
| (53.442) | Coupang Inc | JPMorgan Chase Bank | (869) | (0,00) |
| 7.635 | Coursera Inc | Morgan Stanley | (4.256) | (0,00) |
| 672.126 | Cracker Barrel Old Country Store Inc | Morgan Stanley | (39.222) | (0,01) |
| 41.769 | Credit Acceptance Corp | Morgan Stanley | (8.213) | (0,00) |
| 274.199 | Credit Agricole SA | Goldman Sachs International | (34.260) | (0,01) |
| (603) | Crescent Energy Co Class A | Morgan Stanley | (34) | (0,00) |
| 7.626 | Crescent Point Energy Corp | Morgan Stanley | (1.556) | (0,00) |
| (3.277) | Crinetics Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (700) | (0,00) |
| 267.829 | CRISPR Therapeutics AG | JPMorgan Chase Bank | (40.787) | (0,01) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|----------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| (797) | CRISPR Therapeutics AG | Morgan Stanley | (255) | (0,00) |
| 139 | Crocs Inc | Morgan Stanley | (476) | (0,00) |
| 56.104 | Cross Country Healthcare Inc | Goldman Sachs International | (5.418) | (0,00) |
| 10.971 | Crowdstrike Holdings Inc Class A | JPMorgan Chase Bank | (4.542) | (0,00) |
| 7 | Crowdstrike Holdings Inc Class A | Morgan Stanley | (4) | (0,00) |
| 57.712 | Crown Castle Inc | Morgan Stanley | (16.540) | (0,00) |
| 77.148 | Crown Holdings Inc | Morgan Stanley | (4.742) | (0,00) |
| 140.222 | CSL Ltd | Goldman Sachs International | (8.793) | (0,00) |
| (8.083) | CSX Corp | Morgan Stanley | (1.401) | (0,00) |
| (202) | CTS Corp | Morgan Stanley | (381) | (0,00) |
| 41.751 | CubeSmart | Morgan Stanley | (6.910) | (0,00) |
| (220) | Cullinan Oncology Inc | Morgan Stanley | (271) | (0,00) |
| 626.729 | Cummins Inc | JPMorgan Chase Bank | (38.882) | (0,01) |
| (946) | Cummins Inc | Morgan Stanley | (1.054) | (0,00) |
| 586.956 | CVS Health Corp | Goldman Sachs International | (26.121) | (0,00) |
| (1.323) | Cymabay Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (1.795) | (0,00) |
| (604) | Cytokinetics Inc | Morgan Stanley | (28.559) | (0,00) |
| 122.829 | Danaher Corp | Morgan Stanley | (13.762) | (0,00) |
| (298) | Darden Restaurants Inc | Morgan Stanley | (417) | (0,00) |
| 76.195 | Darling Ingredients Inc | Morgan Stanley | (12.498) | (0,00) |
| 48.613 | Datadog Inc Class A | Morgan Stanley | (9.410) | (0,00) |
| (100) | Day One Biopharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (45) | (0,00) |
| 954.256 | Deckers Outdoor Corp | JPMorgan Chase Bank | (28.868) | (0,00) |
| (567) | Dell Technologies Inc Class C | Morgan Stanley | (930) | (0,00) |
| (100.396) | Delta Air Lines Inc | Goldman Sachs International | (869) | (0,00) |
| (80.420) | Delta Air Lines Inc | Morgan Stanley | (4.501) | (0,00) |
| 127.444 | Denali Therapeutics Inc | JPMorgan Chase Bank | (9.924) | (0,00) |
| 342.164 | DENTSPLY SIRONA Inc | Goldman Sachs International | (59.391) | (0,01) |
| 72.527 | DENTSPLY SIRONA Inc | Morgan Stanley | (9.936) | (0,00) |
| 812 | Deutsche Bank AG | Morgan Stanley | (72) | (0,00) |
| (127.670) | Devon Energy Corp | Morgan Stanley | (928) | (0,00) |
| 167 | DHT Holdings Inc | Morgan Stanley | (12) | (0,00) |
| 619.646 | Diageo Plc | JPMorgan Chase Bank | (13.820) | (0,00) |
| 332.880 | Diageo Plc | Goldman Sachs International | (11.411) | (0,00) |
| 6.402 | Diamond Offshore Drilling Inc | Morgan Stanley | (742) | (0,00) |
| 31.126 | Diamondback Energy Inc | Morgan Stanley | (1.077) | (0,00) |
| (2.176) | DiamondRock Hospitality Co | Morgan Stanley | (91) | (0,00) |
| (1.370) | Dick's Sporting Goods Inc | Morgan Stanley | (750) | (0,00) |
| 58.020 | Digital Realty Trust Inc | Morgan Stanley | (13.273) | (0,00) |
| 837.747 | Dino Polska SA | JPMorgan Chase Bank | (1.709) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|----------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| (159) | Discover Financial Services | Morgan Stanley | (29) | (0,00) |
| (1.826) | DISH Network Corp Class A | Morgan Stanley | (47.675) | (0,00) |
| 4.465.000 | DISH Network Corp | Nomura | (309.246) | (0,02) |
| (242) | Distribution Solutions Group Inc | Morgan Stanley | (43) | (0,00) |
| 3.012.279 | DNB Bank ASA | Goldman Sachs International | (14.616) | (0,00) |
| 3.000 | DocuSign Inc | Morgan Stanley | (2.560) | (0,00) |
| (1.945) | Dolby Laboratories Inc Class A | Morgan Stanley | (137) | (0,00) |
| 59.647 | Dollar General Corp | Morgan Stanley | (18.624) | (0,00) |
| 428.295 | Dollar General Corp | JPMorgan Chase Bank | (13.531) | (0,00) |
| 64.556 | Dollar Tree Inc | Morgan Stanley | (23.574) | (0,00) |
| 65.637 | Dominion Energy Inc | Morgan Stanley | (7.779) | (0,00) |
| 827.832 | Domino's Pizza Inc | Morgan Stanley | (100.725) | (0,01) |
| 677 | Donaldson Co Inc | Morgan Stanley | (224) | (0,00) |
| 364.614 | DoorDash Inc Class A | Morgan Stanley | (58.859) | (0,01) |
| 33.138 | DoubleVerify Holdings Inc | Morgan Stanley | (13.702) | (0,00) |
| 71.707 | Dover Corp | Morgan Stanley | (8.977) | (0,00) |
| 71.625 | Dow Inc | Morgan Stanley | (6.873) | (0,00) |
| 30.566 | Doximity Inc Class A | JPMorgan Chase Bank | (4.640) | (0,00) |
| 36.595 | Doximity Inc Class A | Goldman Sachs International | (4.614) | (0,00) |
| (472.403) | DR Horton Inc | JPMorgan Chase Bank | (3.610) | (0,00) |
| 59.681 | DR Horton Inc | Morgan Stanley | (29.548) | (0,00) |
| (489.313) | DR Horton Inc | Goldman Sachs International | (138) | (0,00) |
| 53.891 | DraftKings Inc Class A | Morgan Stanley | (12.691) | (0,00) |
| 27 | Dream Finders Homes Inc Class A | Morgan Stanley | (16) | (0,00) |
| 35.611 | Driven Brands Holdings Inc | Morgan Stanley | (7.510) | (0,00) |
| 473.783 | DT Midstream Inc | Goldman Sachs International | (16.873) | (0,00) |
| 38.156 | DT Midstream Inc | Morgan Stanley | (2.302) | (0,00) |
| 10.018 | DTE Energy Co | Morgan Stanley | (1.617) | (0,00) |
| (1.173) | Duckhorn Portfolio Inc | Morgan Stanley | (170) | (0,00) |
| 66.066 | Duke Energy Corp | Morgan Stanley | (11.225) | (0,00) |
| 1.033 | Duolingo Inc | Morgan Stanley | (10.569) | (0,00) |
| (2.001) | DuPont de Nemours Inc | Morgan Stanley | (5.262) | (0,00) |
| (4.280) | DXC Technology Co | Morgan Stanley | (1.400) | (0,00) |
| (10.637) | Dynavax Technologies Corp | Morgan Stanley | (6.355) | (0,00) |
| (2.437) | Dyne Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (3.351) | (0,00) |
| 100 | Eagle Bancorp Inc | Morgan Stanley | (73) | (0,00) |
| (307) | Eastman Chemical Co | Morgan Stanley | (10) | (0,00) |
| 68.803 | Eaton Corp Plc | Morgan Stanley | (10.578) | (0,00) |
| 48.978 | eBay Inc | JPMorgan Chase Bank | (1.356) | (0,00) |
| (9.336) | eBay Inc | Morgan Stanley | (3.737) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|---------------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 150.241 | eBay Inc | Goldman Sachs International | (5.620) | (0,00) |
| (9) | EchoStar Corp Class A | Morgan Stanley | (24) | (0,00) |
| 280.114 | Edgewell Personal Care Co | JPMorgan Chase Bank | (11.482) | (0,00) |
| 324.762 | Edgewell Personal Care Co | Goldman Sachs International | (14.436) | (0,00) |
| 38.853 | Edwards Lifesciences Corp | JPMorgan Chase Bank | (4.792) | (0,00) |
| 204.542 | Edwards Lifesciences Corp | Goldman Sachs International | (10.708) | (0,00) |
| (1.923) | Edwards Lifesciences Corp | Morgan Stanley | (2.926) | (0,00) |
| 106.563 | eFFECTOR Therapeutics | Goldman Sachs International | (9.425) | (0,00) |
| 39.179 | Elanco Animal Health Inc | Morgan Stanley | (10.221) | (0,00) |
| 17.079 | Electronic Arts Inc | JPMorgan Chase Bank | (33) | (0,00) |
| 85.276 | Electronic Arts Inc | Morgan Stanley | (5.333) | (0,00) |
| 21.620 | Electronic Arts Inc | Goldman Sachs International | (2.961) | (0,00) |
| 31.128 | Element Solutions Inc | Morgan Stanley | (10.069) | (0,00) |
| 506.881 | Elevance Health Inc | Goldman Sachs International | (2.265) | (0,00) |
| 1.594 | elf Beauty Inc | Morgan Stanley | (3.089) | (0,00) |
| (556.553) | Eli Lilly & Co | JPMorgan Chase Bank | (1.984) | (0,00) |
| 260.098 | Eli Lilly & Co | Goldman Sachs International | (4.767) | (0,00) |
| 278.738 | Embeckta Corp | Goldman Sachs International | (19.133) | (0,00) |
| (582) | Emerson Electric Co | Morgan Stanley | (681) | (0,00) |
| 14.580 | Empire State Realty Trust Inc Class A | Morgan Stanley | (2.224) | (0,00) |
| 1.937 | Enact Holdings Inc | Morgan Stanley | (476) | (0,00) |
| (177.422) | Enagas SA | Goldman Sachs International | (9.464) | (0,00) |
| 97.667 | Encompass Health Corp | Goldman Sachs International | (3.805) | (0,00) |
| (6.114) | Endeavor Group Holdings Inc Class A | Morgan Stanley | (2.000) | (0,00) |
| 718.387 | Energisa SA | Goldman Sachs International | (4.395) | (0,00) |
| (10.198) | Energy Fuels Inc | Morgan Stanley | (814) | (0,00) |
| 7.320 | Enerplus Corp | Morgan Stanley | (643) | (0,00) |
| 1.778 | Enfusion Inc | Morgan Stanley | (219) | (0,00) |
| (288) | EngageSmart Inc | Morgan Stanley | (6) | (0,00) |
| 943.380 | Engie Brasil Energia SA | Goldman Sachs International | (14.727) | (0,00) |
| (1.000.000) | ENI SpA | BNP Paribas | (107.432) | (0,01) |
| (845) | Ensign Group Inc | Morgan Stanley | (360) | (0,00) |
| 112.368 | Entegris Inc | Morgan Stanley | (32.974) | (0,00) |
| 939 | Envista Holdings Corp | Morgan Stanley | (148) | (0,00) |
| (858.254) | EOG Resources Inc | JPMorgan Chase Bank | (27.120) | (0,00) |
| 1.899 | EOG Resources Inc | Morgan Stanley | (6.305) | (0,00) |
| 647 | EPR Properties | Morgan Stanley | (155) | (0,00) |
| (10.325) | EQT Corp | Morgan Stanley | (3.915) | (0,00) |
| (307.610) | EQT Corp | JPMorgan Chase Bank | (26.252) | (0,00) |
| 937.214 | Equatorial Energia SA | Goldman Sachs International | (12.996) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|--|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| (11.683) | Equifax Inc | JPMorgan Chase Bank | (108) | (0,00) |
| 60.271 | Equifax Inc | Morgan Stanley | (26.426) | (0,00) |
| 65.409 | Equinix Inc | Morgan Stanley | (11.033) | (0,00) |
| 118 | Equinox Gold Corp | Morgan Stanley | (21) | (0,00) |
| 216 | Equitable Holdings Inc | Morgan Stanley | (21) | (0,00) |
| (4.393) | Equitrans Midstream Corp | Morgan Stanley | (151) | (0,00) |
| 65.405 | Equity LifeStyle Properties Inc | Morgan Stanley | (8.725) | (0,00) |
| 747 | Equity Residential | Morgan Stanley | (231) | (0,00) |
| 189 | Essential Properties Realty Trust Inc | Morgan Stanley | (13) | (0,00) |
| (100) | Establishment Labs Holdings Inc | Morgan Stanley | (221) | (0,00) |
| (78.507) | Estee Lauder Cos Inc Class A | Goldman Sachs International | (653) | (0,00) |
| 414.792 | Etsy Inc | JPMorgan Chase Bank | (6.271) | (0,00) |
| 36.308 | Etsy Inc | Goldman Sachs International | (2.276) | (0,00) |
| 38.144 | Evercore Inc Class A | Morgan Stanley | (10.831) | (0,00) |
| (127.902) | Everest Group Ltd | Morgan Stanley | (15.429) | (0,00) |
| (9.070) | Eversource Energy | Morgan Stanley | (3.815) | (0,00) |
| (1.821) | Evolent Health Inc Class A | Morgan Stanley | (3.927) | (0,00) |
| 221.893 | Evraz Plc | Morgan Stanley | (227.224) | (0,02) |
| 114.551 | Exelixis Inc | Goldman Sachs International | (12.422) | (0,00) |
| 38.754 | Exelixis Inc | JPMorgan Chase Bank | (5.456) | (0,00) |
| (9.364) | Exelon Corp | Morgan Stanley | (6.912) | (0,00) |
| (470) | eXp World Holdings Inc | Morgan Stanley | (198) | (0,00) |
| 4.204 | Expedia Group Inc | Goldman Sachs International | (169) | (0,00) |
| 104.611 | Expedia Group Inc | JPMorgan Chase Bank | (14.513) | (0,00) |
| (4.096) | Expeditors International of Washington Inc | Morgan Stanley | (1.739) | (0,00) |
| 74.196 | Expeditors Intl Wash Inc | Morgan Stanley | (4.679) | (0,00) |
| 66.005 | Extra Space Storage Inc | Morgan Stanley | (25.450) | (0,00) |
| 7.566 | Extreme Networks Inc | Morgan Stanley | (1.960) | (0,00) |
| 236 | EZCORP Inc Class A | Morgan Stanley | (57) | (0,00) |
| 7.983 | F5 Inc | JPMorgan Chase Bank | (1.450) | (0,00) |
| 82.021 | F5 Inc | Morgan Stanley | (13.583) | (0,00) |
| (92) | Fabrinet | Morgan Stanley | (13) | (0,00) |
| 71.527 | FactSet Research Systems Inc | Morgan Stanley | (7.021) | (0,00) |
| 59.441 | Fair Isaac Corp | Morgan Stanley | (20.806) | (0,00) |
| 86 | FB Financial Corp | Morgan Stanley | (41) | (0,00) |
| 1.680 | Federal Realty Investment Trust | Morgan Stanley | (1.605) | (0,00) |
| 16.813 | Federated Hermes Inc | Morgan Stanley | (1.627) | (0,00) |
| 230.860 | FedEx Corp | JPMorgan Chase Bank | (4.732) | (0,00) |
| 63.476 | Fidelity National Information Services Inc | Morgan Stanley | (11.166) | (0,00) |
| 167.511 | FincoBank SpA | Goldman Sachs International | (20.806) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|---------------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| (100) | First Advantage Corp | Morgan Stanley | (38) | (0,00) |
| (1.149) | First American Financial Corp | Morgan Stanley | (719) | (0,00) |
| 528 | First BanCorp | Morgan Stanley | (91) | (0,00) |
| (125.659) | First Citizens BancShares Inc Class A | Morgan Stanley | (2.295) | (0,00) |
| (991) | First Commonwealth Financial Corp | Morgan Stanley | (80) | (0,00) |
| 2.000 | First Financial Bancorp | Morgan Stanley | (235) | (0,00) |
| 73.247 | First Solar Inc | Morgan Stanley | (9.139) | (0,00) |
| (212) | First Watch Restaurant Group Inc | Morgan Stanley | (69) | (0,00) |
| (4.058) | FirstEnergy Corp | Morgan Stanley | (1.425) | (0,00) |
| 5.555.973 | FirstRand Ltd | JPMorgan Chase Bank | (28.776) | (0,00) |
| 172.504 | Fiserv Inc | Morgan Stanley | (17.082) | (0,00) |
| 34.432 | Five Below Inc | Morgan Stanley | (22.652) | (0,00) |
| 12.690 | Fiverr International Ltd | JPMorgan Chase Bank | (1.417) | (0,00) |
| 42.421 | Fiverr International Ltd | Goldman Sachs International | (7.922) | (0,00) |
| 131 | Fiverr International Ltd | Morgan Stanley | (81) | (0,00) |
| 101.894 | Fleetcor Technologies Inc | JPMorgan Chase Bank | (21.170) | (0,00) |
| 1.817 | FLEX LNG Ltd | Morgan Stanley | (1.453) | (0,00) |
| (7.141) | Flex Ltd | Morgan Stanley | (3.615) | (0,00) |
| 62.578 | Flight Centre Travel Group | JPMorgan Chase Bank | (4.553) | (0,00) |
| 21.925 | Flight Centre Travel Group | Goldman Sachs International | (668) | (0,00) |
| 271.327 | Floor & Decor Holdings Inc Class A | JPMorgan Chase Bank | (84.455) | (0,01) |
| 726.095 | Floor & Decor Holdings Inc Class A | Morgan Stanley | (226.047) | (0,02) |
| 840 | Flowserve Corp | Morgan Stanley | (230) | (0,00) |
| 2.900 | Fluor Corp | Morgan Stanley | (872) | (0,00) |
| (258.359) | Flutter Entertainment Plc | JPMorgan Chase Bank | (11.072) | (0,00) |
| 2.852 | Flywire Corp | Morgan Stanley | (933) | (0,00) |
| 34.233 | FNB Corp | Morgan Stanley | (11.458) | (0,00) |
| 263.172 | Ford Motor Co | JPMorgan Chase Bank | (14.776) | (0,00) |
| 2.488.478 | Ford Motor Co | Goldman Sachs International | (529.924) | (0,04) |
| (2.291) | Ford Motor Co | Morgan Stanley | (326) | (0,00) |
| (921) | Fortis Inc | Morgan Stanley | (170) | (0,00) |
| 73.720 | Fortive Corp | Morgan Stanley | (7.900) | (0,00) |
| 267.288 | Fortrea Holdings Inc | Goldman Sachs International | (24.710) | (0,00) |
| (4.452) | Fortrea Holdings Inc | Morgan Stanley | (7.848) | (0,00) |
| 39 | Fortuna Silver Mines Inc | Morgan Stanley | (4) | (0,00) |
| 27.460 | Fortune Brands Innovations Inc | Morgan Stanley | (3.273) | (0,00) |
| 2.625 | Forward Air Corp | Morgan Stanley | (4.466) | (0,00) |
| (13.588) | Fox Corp Class A | Morgan Stanley | (58) | (0,00) |
| (2.241) | Fox Corp Class A | Goldman Sachs International | (4) | (0,00) |
| (57.589) | Fox Corp Class A | JPMorgan Chase Bank | (221) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|------------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| (128.055) | Fox Corp Class B | Morgan Stanley | (4.026) | (0,00) |
| 151 | Franco-Nevada Corp | Morgan Stanley | (164) | (0,00) |
| 67.574 | Franklin Resources Inc | Morgan Stanley | (17.726) | (0,00) |
| (161.042) | Freeport-McMoRan Inc | Morgan Stanley | (15.340) | (0,00) |
| 38.057 | Freshpet Inc | Morgan Stanley | (14.171) | (0,00) |
| 5.486 | Frontdoor Inc | Morgan Stanley | (5.397) | (0,00) |
| 25.885 | Frontier Communications Parent Inc | Morgan Stanley | (23.927) | (0,00) |
| 31.533 | Frontier Investment Corp | Goldman Sachs International | (1.133) | (0,00) |
| 598 | Frontline Plc | Morgan Stanley | (394) | (0,00) |
| 34.090 | FTI Consulting Inc | Morgan Stanley | (4.333) | (0,00) |
| 2.361 | FuboTV Inc | Morgan Stanley | (302) | (0,00) |
| (4.483) | Gaming and Leisure Properties Inc | Morgan Stanley | (2.348) | (0,00) |
| (217.588) | Gap Inc | Goldman Sachs International | (10.344) | (0,00) |
| 444 | Gap Inc | Morgan Stanley | (81) | (0,00) |
| 63.298 | Garmin Ltd | Morgan Stanley | (15.649) | (0,00) |
| 59.470 | Gartner Inc | Morgan Stanley | (18.399) | (0,00) |
| (1.251) | GE HealthCare Technologies Inc | Morgan Stanley | (286) | (0,00) |
| 1.419 | Gen Digital Inc | Morgan Stanley | (232) | (0,00) |
| (8.855) | Genco Shipping & Trading Ltd | Morgan Stanley | (6.114) | (0,00) |
| 1.126.487 | General Mills Inc | JPMorgan Chase Bank | (9.048) | (0,00) |
| 997.446 | General Mills Inc | Morgan Stanley | (9.167) | (0,00) |
| 530.041 | General Mills Inc | Goldman Sachs International | (3.989) | (0,00) |
| (11.768) | General Motors Co | Morgan Stanley | (927) | (0,00) |
| 2.144.987 | Genmab A/S | Goldman Sachs International | (9.954) | (0,00) |
| 2.844.336 | Genmab A/S | JPMorgan Chase Bank | (1.439) | (0,00) |
| 372 | Genuine Parts Co | Morgan Stanley | (30) | (0,00) |
| 1.136 | Genworth Financial Inc Class A | Morgan Stanley | (54) | (0,00) |
| (5.253) | GEO Group Inc | Morgan Stanley | (784) | (0,00) |
| (1.319) | GFL Environmental Inc | Morgan Stanley | (1.758) | (0,00) |
| 693.826 | Gildan Activewear Inc | Morgan Stanley | (47.209) | (0,01) |
| 570.561 | Gilead Sciences Inc | Goldman Sachs International | (30.954) | (0,00) |
| 18.000 | Ginkgo Bioworks Holdings Inc | Morgan Stanley | (2.284) | (0,00) |
| 6.500 | Gitlab Inc Class A | JPMorgan Chase Bank | (130) | (0,00) |
| 33.717 | Gitlab Inc Class A | Goldman Sachs International | (1.104) | (0,00) |
| 108 | Global Net Lease Inc | Morgan Stanley | (11) | (0,00) |
| 342 | Global Payments Inc | Morgan Stanley | (60) | (0,00) |
| 2.397 | Global Payments Inc | JPMorgan Chase Bank | (375) | (0,00) |
| 58.623 | Global Payments Inc | Goldman Sachs International | (10.173) | (0,00) |
| 1.946 | Global-e Online Ltd | Goldman Sachs International | (24) | (0,00) |
| 60.184 | Global-e Online Ltd | JPMorgan Chase Bank | (3.903) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|----------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 42.855 | GlobalFoundries Inc | Morgan Stanley | (2.978) | (0,00) |
| 36.380 | Globant SA | Morgan Stanley | (9.120) | (0,00) |
| 7.893 | Globe Life Inc | Morgan Stanley | (1.124) | (0,00) |
| 81.800 | GoDaddy Inc Class A | JPMorgan Chase Bank | (12.214) | (0,00) |
| 153.382 | GoDaddy Inc Class A | Goldman Sachs International | (36.537) | (0,00) |
| (497) | Gogo Inc | Morgan Stanley | (233) | (0,00) |
| 98 | Golar LNG Ltd | Morgan Stanley | (10) | (0,00) |
| 471 | Golden Entertainment Inc | Morgan Stanley | (290) | (0,00) |
| (2.263) | Golden Ocean Group Ltd | Morgan Stanley | (1.149) | (0,00) |
| 6.767 | Golub Capital BDC Inc | Morgan Stanley | (373) | (0,00) |
| (3) | GoodRx Holdings Inc Class A | Morgan Stanley | (0) | (0,00) |
| 588 | Goodyear Tire & Rubber Co | Morgan Stanley | (166) | (0,00) |
| 180 | Goosehead Insurance Inc Class A | Morgan Stanley | (138) | (0,00) |
| 1.525 | Grand Canyon Education Inc | Morgan Stanley | (13.229) | (0,00) |
| 1.855 | Granite Ridge Resources Inc | Morgan Stanley | (246) | (0,00) |
| 28.993 | Graphic Packaging Holding Co | Morgan Stanley | (5.787) | (0,00) |
| (244) | Gray Television Inc | Morgan Stanley | (66) | (0,00) |
| 100 | Green Dot Corp Class A | Morgan Stanley | (17) | (0,00) |
| 2.658 | Green Plains Inc | Morgan Stanley | (1.529) | (0,00) |
| (1.155) | Grid Dynamics Holdings Inc | Morgan Stanley | (51) | (0,00) |
| 42.910 | Grifols SA | Goldman Sachs International | (3.999) | (0,00) |
| 795 | Grocery Outlet Holding Corp | Morgan Stanley | (20) | (0,00) |
| 2.122.273 | Growthpoint Properties Ltd | JPMorgan Chase Bank | (7.177) | (0,00) |
| 1.241.673 | Growthpoint Properties Ltd | Goldman Sachs International | (6.988) | (0,00) |
| 38.341 | GSK Plc | JPMorgan Chase Bank | (2.329) | (0,00) |
| 140.554 | GSK Plc | Goldman Sachs International | (11.793) | (0,00) |
| 37.275 | GSK Plc | Morgan Stanley | (3.035) | (0,00) |
| 282 | Guess? Inc | Morgan Stanley | (140) | (0,00) |
| 16.797 | Guidewire Software Inc | JPMorgan Chase Bank | (4.811) | (0,00) |
| 25.917 | Guidewire Software Inc | Goldman Sachs International | (6.603) | (0,00) |
| 41.553 | GXO Logistics Inc | Morgan Stanley | (4.349) | (0,00) |
| 152.301 | H Lundbeck A/S | Morgan Stanley | (304) | (0,00) |
| (103.603) | Hain Celestial Group Inc | Morgan Stanley | (7.495) | (0,00) |
| (239.602) | Haleon Plc | Goldman Sachs International | (17.949) | (0,00) |
| (31.625) | Halliburton Co | JPMorgan Chase Bank | (1.748) | (0,00) |
| (7.237) | Hanesbrands Inc | Morgan Stanley | (3.269) | (0,00) |
| 1.012 | Hanmi Financial Corp | Morgan Stanley | (370) | (0,00) |
| 42.476 | Hanover Insurance Group Inc | Morgan Stanley | (554) | (0,00) |
| 699.802 | Harley-Davidson Inc | Morgan Stanley | (80.362) | (0,01) |
| 1.515 | Harmony Biosciences Holdings Inc | Morgan Stanley | (671) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|---------------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| (2.723) | Hartford Financial Services Group Inc | Morgan Stanley | (890) | (0,00) |
| 14.707 | Hasbro Inc | Morgan Stanley | (3.031) | (0,00) |
| 941 | Hawkins Inc | Morgan Stanley | (1.448) | (0,00) |
| 36.615 | Hayward Holdings Inc | Morgan Stanley | (3.524) | (0,00) |
| 903 | HB Fuller Co | Morgan Stanley | (780) | (0,00) |
| 790.064 | HCA Healthcare Inc | Goldman Sachs International | (73.451) | (0,01) |
| 74.365 | HCA Healthcare Inc | Morgan Stanley | (6.539) | (0,00) |
| 66.199 | Healthcare Realty Trust Inc | Morgan Stanley | (11.975) | (0,00) |
| (2.840) | HealthEquity Inc | Morgan Stanley | (2.989) | (0,00) |
| 2.096 | Healthpeak Properties Inc | Morgan Stanley | (47) | (0,00) |
| 100 | Heartland Financial USA Inc | Morgan Stanley | (25) | (0,00) |
| 112 | Hecla Mining Co | Morgan Stanley | (20) | (0,00) |
| 71.402 | Heico Corp | Morgan Stanley | (7.928) | (0,00) |
| 8.471 | Helix Energy Solutions Group Inc | Morgan Stanley | (3.123) | (0,00) |
| 73.907 | Henry Schein Inc | Morgan Stanley | (10.217) | (0,00) |
| 31.566 | Henry Schein Inc | Goldman Sachs International | (4.444) | (0,00) |
| 2.603 | Hercules Capital Inc | Morgan Stanley | (46) | (0,00) |
| 261 | Heritage Financial Corp | Morgan Stanley | (8) | (0,00) |
| (135.711) | Hershey Co | Morgan Stanley | (7.572) | (0,00) |
| (343.074) | Hershey Co | Goldman Sachs International | (169.132) | (0,01) |
| (15.582) | Hertz Global Holdings Inc | Morgan Stanley | (3.684) | (0,00) |
| 72.423 | Hess Corp | Morgan Stanley | (1.734) | (0,00) |
| 42.066 | Hexcel Corp | Morgan Stanley | (3.549) | (0,00) |
| (215.362) | HF Sinclair Corp | Morgan Stanley | (10.451) | (0,00) |
| (305.818) | HF Sinclair Corp | JPMorgan Chase Bank | (13.050) | (0,00) |
| (209) | Hillenbrand Inc | Morgan Stanley | (298) | (0,00) |
| 74.340 | Hilton Worldwide Holdings Inc | Morgan Stanley | (6.788) | (0,00) |
| 716 | Holley Inc | Morgan Stanley | (77) | (0,00) |
| (936.914) | Home Depot Inc | JPMorgan Chase Bank | (10.149) | (0,00) |
| 2.160 | Home Depot Inc | Morgan Stanley | (8.867) | (0,00) |
| 68.564 | Honeywell International Inc | Morgan Stanley | (11.581) | (0,00) |
| 387.830 | Hormel Foods Corp | JPMorgan Chase Bank | (5.742) | (0,00) |
| 239.763 | Hormel Foods Corp | Goldman Sachs International | (873) | (0,00) |
| 280 | Host Hotels & Resorts Inc | Morgan Stanley | (32) | (0,00) |
| 41.845 | Houlihan Lokey Inc | Morgan Stanley | (5.957) | (0,00) |
| 379.817 | Howmet Aerospace Inc | JPMorgan Chase Bank | (47.640) | (0,01) |
| 73.312 | Howmet Aerospace Inc | Morgan Stanley | (3.606) | (0,00) |
| 58.280 | HP Inc | Morgan Stanley | (4.147) | (0,00) |
| (3.859) | Hudson Pacific Properties Inc | Morgan Stanley | (806) | (0,00) |
| (125.051) | Humana Inc | Morgan Stanley | (8.564) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|--|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 67.839 | Humana Inc | Goldman Sachs International | (226) | (0,00) |
| 4.652 | Huntsman Corp | Morgan Stanley | (2.526) | (0,00) |
| 67.762 | Hyatt Hotels Corp Class A | Morgan Stanley | (17.260) | (0,00) |
| (3.297) | IAC Inc | Morgan Stanley | (527) | (0,00) |
| 398.027 | Iberdrola SA | Goldman Sachs International | (64.096) | (0,01) |
| 1.030.195 | ICON Plc | Goldman Sachs International | (51.544) | (0,01) |
| 39.185 | IDACORP Inc | Morgan Stanley | (4.198) | (0,00) |
| (797) | Ideaya Biosciences Inc | Morgan Stanley | (1.235) | (0,00) |
| 56.403 | IDEXX Laboratories Inc | Goldman Sachs International | (22.272) | (0,00) |
| 13.388 | IDEXX Laboratories Inc | JPMorgan Chase Bank | (2.680) | (0,00) |
| (1) | Illinois Tool Works Inc | Morgan Stanley | (0) | (0,00) |
| (560) | Immunovant Inc | Morgan Stanley | (2.828) | (0,00) |
| (511.483) | Imperial Oil Ltd | JPMorgan Chase Bank | (7.082) | (0,00) |
| (139.478) | Imperial Oil Ltd | Morgan Stanley | (604) | (0,00) |
| 484.933 | Incyte Corp | JPMorgan Chase Bank | (31.075) | (0,00) |
| 130.380 | Incyte Corp | Goldman Sachs International | (3.395) | (0,00) |
| (96) | indie Semiconductor Inc Class A | Morgan Stanley | (7) | (0,00) |
| 55.371 | Informatica Inc Class A | Morgan Stanley | (6.958) | (0,00) |
| 56.161 | Ingersoll Rand Inc | Morgan Stanley | (32.703) | (0,00) |
| (34) | Ingredion Inc | Morgan Stanley | (43) | (0,00) |
| (299) | Innovative Industrial Properties Inc | Morgan Stanley | (334) | (0,00) |
| (9.541) | Innoviva Inc | Morgan Stanley | (308) | (0,00) |
| (1.250) | Insmed Inc | Morgan Stanley | (3.422) | (0,00) |
| 9.522 | Inspire Medical Systems Inc | Morgan Stanley | (3.838) | (0,00) |
| 284 | Installed Building Products Inc | Morgan Stanley | (295) | (0,00) |
| (871) | Insteel Industries Inc | Morgan Stanley | (383) | (0,00) |
| 3.949 | Intapp Inc | Morgan Stanley | (3.254) | (0,00) |
| (399) | Integer Holdings Corp | Morgan Stanley | (200) | (0,00) |
| 838 | Integral Ad Science Holding Corp | Morgan Stanley | (695) | (0,00) |
| (12.855) | Intel Corp | Morgan Stanley | (52.006) | (0,01) |
| (1.499) | Intellia Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (139) | (0,00) |
| (811) | Interactive Brokers Group Inc Class A | Morgan Stanley | (488) | (0,00) |
| 68.267 | Intercontinental Exchange Inc | Morgan Stanley | (22.742) | (0,00) |
| (3.821) | International Business Machines Corp | Morgan Stanley | (9.083) | (0,00) |
| 100 | International Business Machines Corp | Goldman Sachs International | (17) | (0,00) |
| 203.646 | International Consolidated Airlines Group SA | Société Générale | (1.490) | (0,00) |
| 59.759 | International Flavors & Fragrances Inc | Morgan Stanley | (19.943) | (0,00) |
| 6.092 | International Money Express Inc | Morgan Stanley | (417) | (0,00) |
| (232.422) | Intesa Sanpaolo | Goldman Sachs International | (7.983) | (0,00) |
| 65.938 | Intuit Inc | Morgan Stanley | (14.132) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|------------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 313.493 | Intuitive Surgical Inc | Goldman Sachs International | (22.531) | (0,00) |
| (112) | Intuitive Surgical Inc | Morgan Stanley | (582) | (0,00) |
| 86.064 | Invitation Homes Inc | Morgan Stanley | (4.013) | (0,00) |
| 64.754 | Ionis Pharmaceuticals Inc | JPMorgan Chase Bank | (15.036) | (0,00) |
| 37.190 | Ionis Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (6.300) | (0,00) |
| (8.895) | Iovance Biotherapeutics Inc | Morgan Stanley | (5.796) | (0,00) |
| 16.523 | Ipsen | Goldman Sachs International | (642) | (0,00) |
| 73.388 | IQVIA Holdings Inc | Morgan Stanley | (10.247) | (0,00) |
| 5.485 | Iron Mountain Inc | Morgan Stanley | (524) | (0,00) |
| 71.511 | Ironwood Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs International | (10.401) | (0,00) |
| 133.067 | Jabil Inc | Morgan Stanley | (4.962) | (0,00) |
| 37.180 | Jack Henry & Associates Inc | Morgan Stanley | (5.606) | (0,00) |
| 401.038 | Jacobs Solutions Inc | JPMorgan Chase Bank | (5.970) | (0,00) |
| 75.215 | Jacobs Solutions Inc | Goldman Sachs International | (1.421) | (0,00) |
| 346 | Jacobs Solutions Inc | Morgan Stanley | (33) | (0,00) |
| 266 | James River Group Holdings Ltd | Morgan Stanley | (107) | (0,00) |
| 5.498 | Janus Henderson Group Plc | Morgan Stanley | (820) | (0,00) |
| (1.293) | Janus International Group Inc | Morgan Stanley | (841) | (0,00) |
| 109.468 | Jazz Pharmaceuticals Plc | Goldman Sachs International | (2.894) | (0,00) |
| (140.383) | Jazz Pharmaceuticals Plc | Morgan Stanley | (2.889) | (0,00) |
| 19.363 | Jazz Pharmaceuticals Plc | JPMorgan Chase Bank | (157) | (0,00) |
| 33.050 | JB Hi-Fi Ltd | JPMorgan Chase Bank | (5.247) | (0,00) |
| 74.437 | JB Hunt Transport Services Inc | Morgan Stanley | (6.450) | (0,00) |
| 126.259 | Jeronimo Martins SGPS SA | JPMorgan Chase Bank | (1.591) | (0,00) |
| 154.994 | Jeronimo Martins SGPS SA | Goldman Sachs International | (331) | (0,00) |
| 1.958 | JetBlue Airways Corp | Morgan Stanley | (427) | (0,00) |
| 307 | JFrog Ltd | Morgan Stanley | (47) | (0,00) |
| (153) | JM Smucker Co | Morgan Stanley | (147) | (0,00) |
| 2.743 | John Wiley & Sons Inc Class A | Morgan Stanley | (4.755) | (0,00) |
| (1.078) | Johnson & Johnson | Morgan Stanley | (2.702) | (0,00) |
| 611.455 | Johnson & Johnson | JPMorgan Chase Bank | (16.333) | (0,00) |
| 285.702 | Johnson & Johnson | Goldman Sachs International | (10.360) | (0,00) |
| 216.039 | Johnson Controls International Plc | JPMorgan Chase Bank | (16.808) | (0,00) |
| (1.384) | Johnson Controls International Plc | Morgan Stanley | (708) | (0,00) |
| (1.923) | JPMorgan Chase & Co | Morgan Stanley | (4.579) | (0,00) |
| (10.930) | Juniper Networks Inc | Morgan Stanley | (2.353) | (0,00) |
| 35.568 | Karuna Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (180.970) | (0,02) |
| (2.495) | KB Home | Morgan Stanley | (718) | (0,00) |
| (2.254) | KBR Inc | Morgan Stanley | (2.659) | (0,00) |
| 70.849 | Kellogg Co | Morgan Stanley | (8.386) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------|--|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 173.910 | Kellogg Co | Goldman Sachs International | (9.270) | (0,00) |
| 738.620 | Kellogg Co | JPMorgan Chase Bank | (40.004) | (0,00) |
| 39.817 | Kemper Corp | Morgan Stanley | (6.804) | (0,00) |
| 442.026 | Kennametal Inc | JPMorgan Chase Bank | (27.671) | (0,00) |
| 3.618 | Kennedy-Wilson Holdings Inc | Morgan Stanley | (44) | (0,00) |
| 65.346 | Kenvue Inc | Morgan Stanley | (10.533) | (0,00) |
| 206.510 | Kenvue Inc | Goldman Sachs International | (2.896) | (0,00) |
| (226.171) | Kenvue Inc | JPMorgan Chase Bank | (5.884) | (0,00) |
| 449.788 | Kering SA | JPMorgan Chase Bank | (2.585) | (0,00) |
| (198.399) | Keurig Dr Pepper Inc | JPMorgan Chase Bank | (3.283) | (0,00) |
| (503.640) | Keurig Dr Pepper Inc | Goldman Sachs International | (5.168) | (0,00) |
| 69.567 | Keurig Dr Pepper Inc | Morgan Stanley | (5.908) | (0,00) |
| 77.839 | Kimco Realty Corp | Morgan Stanley | (12.043) | (0,00) |
| 127.463 | Kinder Morgan Inc | JPMorgan Chase Bank | (466) | (0,00) |
| 65.298 | Kinder Morgan Inc | Morgan Stanley | (6.770) | (0,00) |
| 501.655 | Kinder Morgan Inc | Goldman Sachs International | (13.187) | (0,00) |
| 275 | Kinsale Capital Group Inc | Morgan Stanley | (570) | (0,00) |
| 185 | Kirby Corp | Morgan Stanley | (273) | (0,00) |
| 4.522 | Kite Realty Group Trust | Morgan Stanley | (662) | (0,00) |
| 59.515 | KKR & Co Inc | Morgan Stanley | (23.631) | (0,00) |
| 149.639 | KLA Corp | Morgan Stanley | (24.451) | (0,00) |
| 106 | Knife River Corp | Morgan Stanley | (18) | (0,00) |
| 452 | Knight-Swift Transportation Holdings Inc | Morgan Stanley | (258) | (0,00) |
| 763.103 | Kohls Corp | JPMorgan Chase Bank | (31.811) | (0,00) |
| 389.513 | Kohls Corp | Goldman Sachs International | (99.122) | (0,01) |
| 60.186 | Kraft Heinz Co | Morgan Stanley | (10.617) | (0,00) |
| (38.758.500) | KraneShares CSI China Internet ETF | Morgan Stanley | (13.500) | (0,00) |
| (12.401) | Krispy Kreme Inc | Morgan Stanley | (1.988) | (0,00) |
| 252.750 | Kroger Co | JPMorgan Chase Bank | (6.300) | (0,00) |
| 332.393 | Kroger Co | Goldman Sachs International | (8.207) | (0,00) |
| (6.606) | Kroger Co | Morgan Stanley | (3.740) | (0,00) |
| (998) | Kronos Worldwide Inc | Morgan Stanley | (96) | (0,00) |
| (516) | Kura Oncology Inc | Morgan Stanley | (873) | (0,00) |
| 33.104 | Kymera Therapeutics Inc | Goldman Sachs International | (27.288) | (0,00) |
| 95.474 | Kymera Therapeutics Inc | JPMorgan Chase Bank | (23.573) | (0,00) |
| (1.234.214) | L&F Co Ltd | Goldman Sachs International | (11.139) | (0,00) |
| 66.996 | Laboratory Corp of America Holdings | Morgan Stanley | (26.237) | (0,00) |
| 970.349 | Laboratory Corp of America Holdings | Goldman Sachs International | (92.988) | (0,01) |
| 18.655 | Ladder Capital Corp | Morgan Stanley | (4.768) | (0,00) |
| 455 | Lamar Advertising Co Class A | Morgan Stanley | (445) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|--------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 418 | Lattice Semiconductor Corp | Morgan Stanley | (538) | (0,00) |
| 900 | Laureate Education Inc | Morgan Stanley | (207) | (0,00) |
| 581.849 | Lear Corp | JPMorgan Chase Bank | (24.139) | (0,00) |
| 920.862 | Lear Corp | Goldman Sachs International | (32.706) | (0,01) |
| (278.307) | Legend Biotech Corp | JPMorgan Chase Bank | (11.806) | (0,00) |
| (6.490) | Legend Biotech Corp | Goldman Sachs International | (159) | (0,00) |
| 1.530 | Leggett & Platt Inc | Morgan Stanley | (42) | (0,00) |
| (2.768) | LendingClub Corp | Morgan Stanley | (207) | (0,00) |
| 36.908 | Lennar Corp Class B | Morgan Stanley | (12.320) | (0,00) |
| (3.870) | Leonardo DRS Inc | Morgan Stanley | (4.286) | (0,00) |
| (278) | Leslie's Inc | Morgan Stanley | (6) | (0,00) |
| 713.739 | Levi Strauss & Co Class A | JPMorgan Chase Bank | (78.304) | (0,01) |
| (6.006) | Levi Strauss & Co Class A | Morgan Stanley | (5.691) | (0,00) |
| (3.843) | Liberty Broadband Corp Class C | Morgan Stanley | (8.894) | (0,00) |
| (32.515) | Liberty Global Ltd Class C | Morgan Stanley | (38.157) | (0,01) |
| 69.441 | Liberty Media Corp | Morgan Stanley | (8.537) | (0,00) |
| 84.121 | Liberty Media Corp Class A | Morgan Stanley | (4.885) | (0,00) |
| (83.089) | Liberty Media Corp Class C | Morgan Stanley | (4.577) | (0,00) |
| (490.225) | Life Time Group Holdings Inc | Morgan Stanley | (23.093) | (0,00) |
| (8.105) | LifeStance Health Group Inc | Morgan Stanley | (3.527) | (0,00) |
| 994 | Lincoln National Corp | Morgan Stanley | (431) | (0,00) |
| 66.867 | Linde Plc | Morgan Stanley | (7.590) | (0,00) |
| (870) | Lithia Motors Inc | Morgan Stanley | (14.194) | (0,00) |
| 42.858 | Littelfuse Inc | Morgan Stanley | (6.642) | (0,00) |
| 8.849 | Live Nation Entertainment Inc | JPMorgan Chase Bank | (781) | (0,00) |
| 44.629 | Live Nation Entertainment Inc | Goldman Sachs International | (4.912) | (0,00) |
| (2.616) | LKQ Corp | Morgan Stanley | (45) | (0,00) |
| (357.021) | Lloyds Banking Group Plc | Goldman Sachs International | (40.283) | (0,01) |
| 213.587 | Lockheed Martin Corp | Goldman Sachs International | (1.680) | (0,00) |
| 93.538 | Lockheed Martin Corp | JPMorgan Chase Bank | (1.433) | (0,00) |
| 77.821 | Loews Corp | Morgan Stanley | (1.126) | (0,00) |
| (470) | Logitech International S.A. | Morgan Stanley | (932) | (0,00) |
| 173.382 | L'Oreal | Goldman Sachs International | (22.057) | (0,00) |
| 1.262.671 | Lowe's Cos Inc | JPMorgan Chase Bank | (84.575) | (0,01) |
| 74.338 | Lowe's Cos Inc | Morgan Stanley | (8.301) | (0,00) |
| (656) | LSB Industries Inc | Morgan Stanley | (10) | (0,00) |
| 357.228 | Lululemon Athletica Inc | JPMorgan Chase Bank | (12.732) | (0,00) |
| 43.521 | Lumentum Holdings Inc | Morgan Stanley | (7.705) | (0,00) |
| 6.574 | Lyft Inc Class A | Morgan Stanley | (2.485) | (0,00) |
| (216) | M/I Homes Inc | Morgan Stanley | (1.986) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|---|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| (1.035) | MACOM Technology Solutions Holdings Inc | Morgan Stanley | (73) | (0,00) |
| (7.697) | Macy's Inc | Morgan Stanley | (454) | (0,00) |
| (546.469) | Macy's Inc | JPMorgan Chase Bank | (2.811) | (0,00) |
| (5.617) | Madison Square Garden Entertainment Corp | JPMorgan Chase Bank | (13) | (0,00) |
| (55.053) | Madison Square Garden Entertainment Corp | Goldman Sachs International | (370) | (0,00) |
| 448 | Madison Square Garden Entertainment Corp | Morgan Stanley | (9) | (0,00) |
| (1.071) | Madrigal Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (6.669) | (0,00) |
| 253.330 | Magna International Inc | JPMorgan Chase Bank | (6.116) | (0,00) |
| 455.034 | Magna International Inc | Goldman Sachs International | (6.368) | (0,00) |
| (1.649) | Magna International Inc | Morgan Stanley | (1.338) | (0,00) |
| 368.579 | Magnolia Oil & Gas Corp Class A | JPMorgan Chase Bank | (25.717) | (0,00) |
| (62) | MakeMyTrip Ltd | Morgan Stanley | (89) | (0,00) |
| 1.340 | Manhattan Associates Inc | Morgan Stanley | (6.156) | (0,00) |
| (13.812) | Marathon Digital Holdings Inc | Morgan Stanley | (8.851) | (0,00) |
| 431.906 | Marathon Oil Corp | Goldman Sachs International | (15.407) | (0,00) |
| (838.067) | Marathon Oil Corp | JPMorgan Chase Bank | (46.967) | (0,01) |
| 558 | Marathon Petroleum Corp | Morgan Stanley | (2.755) | (0,00) |
| 117.316 | Marathon Petroleum Corp | JPMorgan Chase Bank | (1.162) | (0,00) |
| (110.913) | Maravai LifeSciences Holdings Inc Class A | Morgan Stanley | (22.185) | (0,00) |
| (265) | Marcus & Millichap Inc | Morgan Stanley | (445) | (0,00) |
| (288) | MarineMax Inc | Morgan Stanley | (567) | (0,00) |
| 73.611 | Markel Group Inc | Morgan Stanley | (172) | (0,00) |
| 65.913 | MarketAxess Holdings Inc | Morgan Stanley | (26.311) | (0,00) |
| 925.787 | Marriott International Inc Class A | JPMorgan Chase Bank | (110.551) | (0,01) |
| 53.832 | Marriott International Inc Class A | Goldman Sachs International | (4.092) | (0,00) |
| 70.215 | Marriott International Inc Class A | Morgan Stanley | (12.461) | (0,00) |
| (352) | Marsh & McLennan Cos Inc | Morgan Stanley | (193) | (0,00) |
| 1.581.697 | Martin Marietta Materials Inc | Goldman Sachs International | (186.880) | (0,02) |
| 129.634 | Martin Marietta Materials Inc | JPMorgan Chase Bank | (11.772) | (0,00) |
| 84.434 | Marvell Technology Inc | Morgan Stanley | (13.368) | (0,00) |
| 5.659 | Masco Corp | Morgan Stanley | (3.566) | (0,00) |
| 39.340 | Masimo Corp | Morgan Stanley | (13.795) | (0,00) |
| 144.951 | MasTec Inc | Goldman Sachs International | (16.893) | (0,00) |
| 41.746 | MasTec Inc | Morgan Stanley | (13.833) | (0,00) |
| 63.758 | Mastercard Inc Class A | Morgan Stanley | (4.324) | (0,00) |
| 503 | Matthews International Corp Class A | Morgan Stanley | (298) | (0,00) |
| 688.738 | McCormick & Co Inc | Morgan Stanley | (76.142) | (0,01) |
| (217) | McDonald's Corp | Morgan Stanley | (693) | (0,00) |
| 669.945 | McKesson Corp | Goldman Sachs International | (9.628) | (0,00) |
| 16 | MDU Resources Group Inc | Morgan Stanley | (1) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|------------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 218 | Medical Properties Trust Inc | Morgan Stanley | (34) | (0,00) |
| (4.939) | Medtronic Plc | Morgan Stanley | (4.955) | (0,00) |
| 64.289 | Meituan Class B | Société Générale | (24) | (0,00) |
| 116 | MercadoLibre Inc | Morgan Stanley | (5.193) | (0,00) |
| (363) | Merchants Bancorp | Morgan Stanley | (262) | (0,00) |
| (519.863) | Merck & Co Inc | JPMorgan Chase Bank | (21.783) | (0,00) |
| 173.384 | Merck KGaA | JPMorgan Chase Bank | (12.704) | (0,00) |
| 291.922 | Merck KGaA | Goldman Sachs International | (11.067) | (0,00) |
| 44.532 | Mercury Systems Inc | Morgan Stanley | (784) | (0,00) |
| (464) | Meritage Homes Corp | Morgan Stanley | (347) | (0,00) |
| (1.794) | Meta Platforms Inc | Morgan Stanley | (4.492) | (0,00) |
| 56.794 | Mettler-Toledo International Inc | Goldman Sachs International | (1.380) | (0,00) |
| 22.794 | Mettler-Toledo International Inc | JPMorgan Chase Bank | (2.657) | (0,00) |
| 74.316 | Mettler-Toledo International Inc | Morgan Stanley | (8.097) | (0,00) |
| 1.450 | MFA Financial Inc | Morgan Stanley | (645) | (0,00) |
| (100) | MGE Energy Inc | Morgan Stanley | (115) | (0,00) |
| 1.228 | MGIC Investment Corp | Morgan Stanley | (230) | (0,00) |
| 125.514 | Microchip Technology Inc | Morgan Stanley | (9.923) | (0,00) |
| 59.366 | Micron Technology Inc | Morgan Stanley | (42.139) | (0,00) |
| (109.618) | Microsoft Corp | Morgan Stanley | (3.387) | (0,00) |
| 19.664 | MiMedx Group Inc | Morgan Stanley | (5.666) | (0,00) |
| 42.160 | Mirati Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (1.384) | (0,00) |
| 45.891 | Mister Car Wash Inc | Morgan Stanley | (8.666) | (0,00) |
| 287.721 | Moderna Inc | JPMorgan Chase Bank | (70.243) | (0,01) |
| 74.344 | Moderna Inc | Goldman Sachs International | (20.759) | (0,00) |
| (13.780) | Moderna Inc | Morgan Stanley | (159.196) | (0,01) |
| 398 | Moelis & Co Class A | Morgan Stanley | (220) | (0,00) |
| 116.404 | Mohawk Industries Inc | Goldman Sachs International | (5.571) | (0,00) |
| 366.447 | Mohawk Industries Inc | JPMorgan Chase Bank | (61.490) | (0,01) |
| 91 | Mohawk Industries Inc | Morgan Stanley | (4) | (0,00) |
| 388.771 | Molina Healthcare Inc | Goldman Sachs International | (3) | (0,00) |
| (980) | Molina Healthcare Inc | Morgan Stanley | (8.434) | (0,00) |
| 240.978 | Molson Coors Beverage Co Class B | JPMorgan Chase Bank | (6.846) | (0,00) |
| 611.938 | Molson Coors Beverage Co Class B | Morgan Stanley | (34.898) | (0,01) |
| 103 | Monday.com Ltd | Morgan Stanley | (535) | (0,00) |
| 66.900 | Mondelez International Inc Class A | Morgan Stanley | (13.605) | (0,00) |
| (55.172) | MongoDB Inc | Morgan Stanley | (5.822) | (0,00) |
| (5.361) | MongoDB Inc | JPMorgan Chase Bank | (59) | (0,00) |
| (1.661) | MongoDB Inc | Goldman Sachs International | (29) | (0,00) |
| 47.048 | Monolithic Power Systems Inc | Morgan Stanley | (19.708) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|-----------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 388 | Monro Inc | Morgan Stanley | (894) | (0,00) |
| (4.366) | Monster Beverage Corp | Morgan Stanley | (13.023) | (0,00) |
| 327 | Mosaic Co | Morgan Stanley | (188) | (0,00) |
| 38.828 | MP Materials Corp | Morgan Stanley | (12.422) | (0,00) |
| 168.285 | Murphy Oil Corp | Goldman Sachs International | (11.561) | (0,00) |
| 428.918 | Murphy Oil Corp | JPMorgan Chase Bank | (7.637) | (0,00) |
| 3.449 | Murphy Oil Corp | Morgan Stanley | (4.130) | (0,00) |
| 190.018 | Murphy USA Inc | JPMorgan Chase Bank | (562) | (0,00) |
| 569.786 | Murphy USA Inc | Goldman Sachs International | (2.310) | (0,00) |
| 6.090 | Myriad Genetics Inc | Morgan Stanley | (9.201) | (0,00) |
| 63.592 | Nasdaq Inc | Morgan Stanley | (13.147) | (0,00) |
| (1.319.961) | Naspers Ltd | Morgan Stanley | (2.243) | (0,00) |
| (4.535.952) | Naspers Ltd | Goldman Sachs International | (16.856) | (0,00) |
| 33.193 | Natera Inc | Morgan Stanley | (13.407) | (0,00) |
| (77.843) | National Fuel Gas Co | Morgan Stanley | (351) | (0,00) |
| 91.591 | National Grid Plc | Goldman Sachs International | (12.279) | (0,00) |
| 32.222 | National Storage Affiliates Trust | Morgan Stanley | (16.585) | (0,00) |
| (4.416) | Navitas Semiconductor Corp | Morgan Stanley | (349) | (0,00) |
| 40.338 | nCino Inc | Morgan Stanley | (7.678) | (0,00) |
| (4.365) | NCR Voyix Corp | Morgan Stanley | (2.021) | (0,00) |
| 4.898.911 | Nedbank Group Ltd | JPMorgan Chase Bank | (9.718) | (0,00) |
| 55.999 | NetApp Inc | Morgan Stanley | (9.450) | (0,00) |
| 110.326 | Netflix Inc | JPMorgan Chase Bank | (9.686) | (0,00) |
| 10.092 | Netflix Inc | Goldman Sachs International | (112) | (0,00) |
| 1.776 | NETGEAR Inc | Morgan Stanley | (308) | (0,00) |
| 1.697 | NetScout Systems Inc | Morgan Stanley | (1.386) | (0,00) |
| (2.460) | NETSTREIT Corp | Morgan Stanley | (695) | (0,00) |
| 38.752 | Neurocrine Biosciences Inc | Goldman Sachs International | (15.644) | (0,00) |
| 34.183 | New Fortress Energy Inc | Morgan Stanley | (7.983) | (0,00) |
| (8.453) | New Fortress Energy Inc Class A | Morgan Stanley | (9.974) | (0,00) |
| 100 | New Mountain Finance Corp | Morgan Stanley | (31) | (0,00) |
| 4.463 | New York Mortgage Trust Inc | Morgan Stanley | (1.448) | (0,00) |
| 76.984 | New York Times Co Class A | JPMorgan Chase Bank | (9.734) | (0,00) |
| 43.736 | New York Times Co Class A | Goldman Sachs International | (6.414) | (0,00) |
| 10.081 | New York Times Co Class A | Morgan Stanley | (2.012) | (0,00) |
| 196.414 | Newell Brands Inc | JPMorgan Chase Bank | (19.647) | (0,00) |
| 217.084 | Newell Brands Inc | Goldman Sachs International | (32.447) | (0,01) |
| 41.029 | Newell Brands Inc | Morgan Stanley | (2.109) | (0,00) |
| 36.848 | Newmarket Corp | Morgan Stanley | (7.829) | (0,00) |
| 64.155 | Newmont Corp | Morgan Stanley | (10.970) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|---------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 54.244 | News Corp Class A | Goldman Sachs International | (5.337) | (0,00) |
| 52.163 | News Corp Class A | Morgan Stanley | (24.009) | (0,00) |
| 21.938 | News Corp Class A | JPMorgan Chase Bank | (1.659) | (0,00) |
| (672) | NexGen Energy Ltd | Morgan Stanley | (125) | (0,00) |
| (13.597) | NextDecade Corp | Morgan Stanley | (1.991) | (0,00) |
| (4.384) | NextEra Energy Partners LP | Morgan Stanley | (967) | (0,00) |
| 66.361 | NEXTracker Inc Class A | Morgan Stanley | (7.320) | (0,00) |
| 2.632 | NIKE Inc Class B | Morgan Stanley | (6.166) | (0,00) |
| 1.556 | NMI Holdings Inc Class A | Morgan Stanley | (34) | (0,00) |
| (97.032) | NN Group NV | Goldman Sachs International | (126) | (0,00) |
| 417.546 | Noble Corp Plc | Goldman Sachs International | (63.156) | (0,01) |
| (1.619) | Noble Corp Plc | Morgan Stanley | (2.520) | (0,00) |
| 1.054 | Nomad Foods Ltd | Morgan Stanley | (22) | (0,00) |
| (75.718) | Nordex SE | Goldman Sachs International | (85) | (0,00) |
| 69.438 | Nordson Corp | Morgan Stanley | (20.502) | (0,00) |
| (5.767) | Nordstrom Inc | Morgan Stanley | (1.833) | (0,00) |
| (1.352) | Norfolk Southern Corp | Morgan Stanley | (6.068) | (0,00) |
| 73.776 | Northern Trust Corp | Morgan Stanley | (5.766) | (0,00) |
| 246.711 | NOV Inc | JPMorgan Chase Bank | (5.915) | (0,00) |
| (41.994) | NOV Inc | Morgan Stanley | (3.381) | (0,00) |
| (125.832) | Novartis AG | JPMorgan Chase Bank | (920) | (0,00) |
| 54.733 | NRG Energy Inc | Morgan Stanley | (29.504) | (0,00) |
| (4.682) | NU Holdings Ltd Class A | JPMorgan Chase Bank | (79) | (0,00) |
| 1.384 | Nu Skin Enterprises Inc Class A | Morgan Stanley | (159) | (0,00) |
| (445) | Nurix Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (136) | (0,00) |
| 1.037 | Nutrien Ltd | Morgan Stanley | (259) | (0,00) |
| (76) | nVent Electric Plc | Morgan Stanley | (15) | (0,00) |
| (615) | NXP Semiconductors NV | Morgan Stanley | (2.520) | (0,00) |
| 1.929 | Oaktree Specialty Lending Corp | Morgan Stanley | (370) | (0,00) |
| (285.497) | Occidental Petroleum Corp | Morgan Stanley | (6.255) | (0,00) |
| (19.893) | Occidental Petroleum Corp | JPMorgan Chase Bank | (6.859) | (0,00) |
| 20.845 | Oddity Tech Ltd Class A | JPMorgan Chase Bank | (3.605) | (0,00) |
| 41.856 | OGE Energy Corp | Morgan Stanley | (4.089) | (0,00) |
| 369 | O-I Glass Inc | Morgan Stanley | (63) | (0,00) |
| 73.883 | Okta Inc | Morgan Stanley | (21.109) | (0,00) |
| (647) | Okta Inc Class A | Morgan Stanley | (2.262) | (0,00) |
| 14.458 | Olaplex Holdings Inc | JPMorgan Chase Bank | (5.496) | (0,00) |
| 1.174.935 | Old Dominion Freight Line | Goldman Sachs International | (47.758) | (0,01) |
| 444.774 | Old Dominion Freight Line | JPMorgan Chase Bank | (37.592) | (0,01) |
| 1.339 | Old Dominion Freight Line Inc | Morgan Stanley | (2.151) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|-------------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| (13.712) | Old National Bancorp | Morgan Stanley | (401) | (0,00) |
| 34.302 | Olin Corp | Morgan Stanley | (5.191) | (0,00) |
| (21) | Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc | Morgan Stanley | (17) | (0,00) |
| (1.365) | OmniAb Inc | Morgan Stanley | (635) | (0,00) |
| (19.718) | ON Semiconductor Corp | Morgan Stanley | (17.407) | (0,00) |
| 72 | OneMain Holdings Inc | Morgan Stanley | (32) | (0,00) |
| 121.434 | ONEOK Inc | JPMorgan Chase Bank | (3.508) | (0,00) |
| 580.328 | ONEOK Inc | Goldman Sachs International | (37.460) | (0,01) |
| 67.955 | ONEOK Inc | Morgan Stanley | (9.364) | (0,00) |
| 24 | OneSpan Inc | Morgan Stanley | (15) | (0,00) |
| (1.575) | Open Text Corp | Morgan Stanley | (435) | (0,00) |
| 126.395 | Option Care Health Inc | Goldman Sachs International | (25.810) | (0,00) |
| 472 | Option Care Health Inc | Morgan Stanley | (77) | (0,00) |
| (23.888) | Oracle Corp | JPMorgan Chase Bank | (1.540) | (0,00) |
| (117.854) | Oracle Corp | Morgan Stanley | (1.687) | (0,00) |
| (4.086) | OraSure Technologies Inc | Morgan Stanley | (1.016) | (0,00) |
| 264 | O'Reilly Automotive Inc | Morgan Stanley | (1.554) | (0,00) |
| (103.362) | Organon & Co | Morgan Stanley | (6.537) | (0,00) |
| 83.126 | Orion Oyj | Goldman Sachs International | (7.944) | (0,00) |
| 143.177 | Orion Oyj | JPMorgan Chase Bank | (10.559) | (0,00) |
| 8.276 | Ormat Technologies Inc | Morgan Stanley | (325) | (0,00) |
| 187.062 | Ormat Technologies Inc | JPMorgan Chase Bank | (25.716) | (0,00) |
| 70.778 | Otis Worldwide Corp | Morgan Stanley | (9.111) | (0,00) |
| (691) | Otter Tail Corp | Morgan Stanley | (436) | (0,00) |
| 8.701 | Outfront Media Inc | Morgan Stanley | (1.212) | (0,00) |
| (489.361) | Ovintiv Inc | JPMorgan Chase Bank | (8.786) | (0,00) |
| (522.456) | Ovintiv Inc | Goldman Sachs International | (15.871) | (0,00) |
| 704 | Owens & Minor Inc | Morgan Stanley | (808) | (0,00) |
| 165 | Owens Corning | Morgan Stanley | (53) | (0,00) |
| 73.825 | PACCAR Inc | Morgan Stanley | (5.138) | (0,00) |
| 571 | Pacific Premier Bancorp Inc | Morgan Stanley | (34) | (0,00) |
| 37.045 | Pacira BioSciences Inc | JPMorgan Chase Bank | (6.205) | (0,00) |
| 451 | Packaging Corp of America | Morgan Stanley | (314) | (0,00) |
| 5.227 | PagerDuty Inc | Morgan Stanley | (3.941) | (0,00) |
| (657) | PageSeguro Digital Ltd Class A | Morgan Stanley | (279) | (0,00) |
| 54.887 | Palantir Technologies Inc Class A | Morgan Stanley | (5.411) | (0,00) |
| (5.471) | Pan American Silver Corp | Morgan Stanley | (1.065) | (0,00) |
| (303) | Papa John's International Inc | Morgan Stanley | (965) | (0,00) |
| (814) | Par Pacific Holdings Inc | Morgan Stanley | (471) | (0,00) |
| 453.937 | Patterson Cos Inc | Goldman Sachs International | (5.192) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|------------|---------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 904 | Patterson-UTI Energy Inc | Morgan Stanley | (248) | (0,00) |
| 228.034 | Paychex Inc | JPMorgan Chase Bank | (10.666) | (0,00) |
| 1.151 | Paychex Inc | Morgan Stanley | (623) | (0,00) |
| 462 | Paycor HCM Inc | Morgan Stanley | (53) | (0,00) |
| 128.605 | Paylocity Holding Corp | JPMorgan Chase Bank | (5.260) | (0,00) |
| 96.394 | Paylocity Holding Corp | Goldman Sachs International | (4.701) | (0,00) |
| 351 | Paylocity Holding Corp | Morgan Stanley | (47) | (0,00) |
| (394) | Payoneer Global Inc | Morgan Stanley | (90) | (0,00) |
| 3.404 | PayPal Holdings Inc | Morgan Stanley | (8.781) | (0,00) |
| (2.095) | PayPal Holdings Inc | Goldman Sachs International | (41) | (0,00) |
| (8.885) | Peabody Energy Corp | Morgan Stanley | (1.453) | (0,00) |
| 25.550.000 | Peabody Energy Corp | Nomura | (1.505.320) | (0,10) |
| 1.463 | Peakstone Realty Trust | Morgan Stanley | (87) | (0,00) |
| (18.096) | Pebblebrook Hotel Trust | Morgan Stanley | (7.842) | (0,00) |
| 2.449 | Pegasystems Inc | Morgan Stanley | (2.415) | (0,00) |
| 1.855 | Pembina Pipeline Corp | Morgan Stanley | (435) | (0,00) |
| 40.443 | Penn Entertainment Inc | Morgan Stanley | (1.190) | (0,00) |
| 45.824 | Penske Automotive Group Inc | Morgan Stanley | (115) | (0,00) |
| 949.300 | Pentair Plc | JPMorgan Chase Bank | (30.330) | (0,00) |
| 135.987 | Pentair Plc | Goldman Sachs International | (2.987) | (0,00) |
| 42.146 | Penumbra Inc | Morgan Stanley | (5.207) | (0,00) |
| (697.066) | PepsiCo Inc | Goldman Sachs International | (32.681) | (0,01) |
| 1.966 | Perdoceo Education Corp | Morgan Stanley | (16) | (0,00) |
| 34.270 | Performance Food Group Co | Morgan Stanley | (2.881) | (0,00) |
| (14.256) | Permian Resources Corp | Morgan Stanley | (3.684) | (0,00) |
| 204.516 | Perrigo Co Plc | Goldman Sachs International | (16.893) | (0,00) |
| 394.450 | Petropavlovsk Plc | Morgan Stanley | (5.992) | (0,00) |
| (44.970) | Pfizer Inc | Morgan Stanley | (43.051) | (0,01) |
| 603.572 | Pfizer Inc | JPMorgan Chase Bank | (39.377) | (0,01) |
| 462.110 | Pfizer Inc | Goldman Sachs International | (14.072) | (0,00) |
| 57.276 | PG&E Corp | Morgan Stanley | (14.762) | (0,00) |
| (3.265) | Phathom Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (2.180) | (0,00) |
| (1.193) | Philip Morris International Inc | Morgan Stanley | (396) | (0,00) |
| 107 | Phinia Inc | Morgan Stanley | (26) | (0,00) |
| 40.545 | Pilgrim's Pride Corp | Morgan Stanley | (3.870) | (0,00) |
| 37.401 | Pinnacle Financial Partners Inc | Morgan Stanley | (13.038) | (0,00) |
| 1.690 | Pinterest Inc Class A | Goldman Sachs International | (4) | (0,00) |
| 58.551 | Pinterest Inc Class A | Morgan Stanley | (23.296) | (0,00) |
| 28.385 | Pinterest Inc Class A | JPMorgan Chase Bank | (3.979) | (0,00) |
| (124.304) | Pioneer Natural Resources Co | Morgan Stanley | (3.185) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|------------|-------------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 30.085 | Planet Fitness Inc Class A | Morgan Stanley | (15.779) | (0,00) |
| (4.314) | Pliant Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (6.566) | (0,00) |
| 8.402 | Plymouth Industrial REIT Inc | Morgan Stanley | (2.449) | (0,00) |
| (96.218) | Polaris Inc | Morgan Stanley | (3.292) | (0,00) |
| 1.214.483 | Polski Koncern Naftowy ORLEN SA | Goldman Sachs International | (9.068) | (0,00) |
| 280.024 | Polski Koncern Naftowy ORLEN SA | JPMorgan Chase Bank | (1.354) | (0,00) |
| 65.161 | Polymetal International Plc | Morgan Stanley | (140.096) | (0,01) |
| (71) | Pool Corp | Morgan Stanley | (274) | (0,00) |
| 1.226 | Portillo's Inc Class A | Morgan Stanley | (345) | (0,00) |
| (587) | Portland General Electric Co | Morgan Stanley | (17) | (0,00) |
| 563.436 | Porto Seguro SA | Goldman Sachs International | (1.773) | (0,00) |
| (276.033) | POSCO Holdings Inc | Goldman Sachs International | (894) | (0,00) |
| 10.800.000 | POSCO Holdings Inc | Société Générale | (451.587) | (0,03) |
| 42.575 | Post Holdings Inc | Morgan Stanley | (2.112) | (0,00) |
| 315.873 | Poste Italiane SpA | Goldman Sachs International | (13.858) | (0,00) |
| (1.611) | PowerSchool Holdings Inc Class A | Morgan Stanley | (289) | (0,00) |
| 10.543 | Principal Financial Group Inc | Morgan Stanley | (4.352) | (0,00) |
| (2.452) | PROCEPT BioRobotics Corp | Morgan Stanley | (3.795) | (0,00) |
| 124.790 | PROCEPT BioRobotics Corp | Goldman Sachs International | (10.499) | (0,00) |
| 22.765 | Procore Technologies Inc | JPMorgan Chase Bank | (157) | (0,00) |
| 29.236 | Procore Technologies Inc | Goldman Sachs International | (5.010) | (0,00) |
| 17.449 | Procore Technologies Inc | Morgan Stanley | (1.789) | (0,00) |
| (1.995) | Procter & Gamble Co | Morgan Stanley | (2.648) | (0,00) |
| (38.190) | Procter & Gamble Co | Goldman Sachs International | (15.777) | (0,00) |
| 2.757 | PROG Holdings Inc | Morgan Stanley | (840) | (0,00) |
| 972 | Progress Software Corp | Morgan Stanley | (1.083) | (0,00) |
| 63.298 | Progressive Corp | Morgan Stanley | (9.510) | (0,00) |
| (4.160) | Prologis Inc | Morgan Stanley | (4.184) | (0,00) |
| 7.307 | ProPetro Holding Corp | Morgan Stanley | (1.538) | (0,00) |
| 39.247 | Prosperity Bancshares Inc | Morgan Stanley | (11.425) | (0,00) |
| (50.355) | Protagonist Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (8.806) | (0,00) |
| (39.493) | Protagonist Therapeutics Inc | JPMorgan Chase Bank | (8.397) | (0,00) |
| 267 | Proto Labs Inc | Morgan Stanley | (65) | (0,00) |
| 3.038 | Provident Financial Services Inc | Morgan Stanley | (803) | (0,00) |
| 26 | PTC Inc | Morgan Stanley | (19) | (0,00) |
| (10.212) | Public Service Enterprise Group Inc | Morgan Stanley | (2.772) | (0,00) |
| (662) | PVH Corp | Morgan Stanley | (439) | (0,00) |
| 1.758 | Q2 Holdings Inc | Morgan Stanley | (215) | (0,00) |
| 38.350 | Qiagen NV | Morgan Stanley | (2.086) | (0,00) |
| 25.110 | QUALCOMM Inc | Morgan Stanley | (6.198) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|---------------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 70.089 | Quanta Services Inc | Morgan Stanley | (16.448) | (0,00) |
| 34.467 | QuantumScape Corp | Morgan Stanley | (5.368) | (0,00) |
| 66.044 | Quest Diagnostics Inc | Morgan Stanley | (12.366) | (0,00) |
| (2.440) | QuidelOrtho Corp | Morgan Stanley | (4.641) | (0,00) |
| (10.793) | R1 RCM Inc | Morgan Stanley | (3.303) | (0,00) |
| 376 | RadNet Inc | Morgan Stanley | (210) | (0,00) |
| (1.572) | Ramaco Resources Inc Class A | Morgan Stanley | (1.122) | (0,00) |
| 335.860 | Range Resources Corp | JPMorgan Chase Bank | (4.613) | (0,00) |
| (5.491) | Range Resources Corp | Morgan Stanley | (2.451) | (0,00) |
| (401) | Ranpak Holdings Corp | Morgan Stanley | (168) | (0,00) |
| 2.157 | Rapid7 Inc | Morgan Stanley | (3.637) | (0,00) |
| 29.887 | Rayonier Inc | Morgan Stanley | (10.559) | (0,00) |
| (1.718) | RB Global Inc | Morgan Stanley | (3.530) | (0,00) |
| 36.730 | RBC Bearings Inc | Morgan Stanley | (20.449) | (0,00) |
| 49.256 | Realty Income Corp | Morgan Stanley | (16.795) | (0,00) |
| (12.493) | Recursion Pharmaceuticals Inc Class A | Morgan Stanley | (562) | (0,00) |
| 257.857 | Redeia Corp SA | Goldman Sachs International | (2.359) | (0,00) |
| 100 | Redwood Trust Inc | Morgan Stanley | (2) | (0,00) |
| 71.502 | Regency Centers Corp | Morgan Stanley | (11.534) | (0,00) |
| 14.420 | Regeneron Pharmaceuticals Inc | JPMorgan Chase Bank | (1.371) | (0,00) |
| (520.820) | Regeneron Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (1.465) | (0,00) |
| 28.588 | Regeneron Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs International | (2.995) | (0,00) |
| 68.301 | Regions Financial Corp | Morgan Stanley | (15.034) | (0,00) |
| (1.940) | Relay Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (721) | (0,00) |
| 71.610 | Reliance Steel & Aluminum | Morgan Stanley | (5.584) | (0,00) |
| 10.516 | RELX Plc | JPMorgan Chase Bank | (1.943) | (0,00) |
| 27.266 | RELX Plc | Goldman Sachs International | (5.224) | (0,00) |
| 1.372 | RELX Plc | Morgan Stanley | (247) | (0,00) |
| 1.266.841 | Remgro Ltd | Morgan Stanley | (13.455) | (0,00) |
| 2.499.691 | Remgro Ltd | JPMorgan Chase Bank | (24.363) | (0,00) |
| (133.276) | Remitly Global Inc | JPMorgan Chase Bank | (14.854) | (0,00) |
| (107.378) | Remitly Global Inc | Goldman Sachs International | (2.586) | (0,00) |
| (36.902) | Remitly Global Inc | Morgan Stanley | (2.844) | (0,00) |
| (87.031) | RenaissanceRe Holdings Ltd | Morgan Stanley | (7.607) | (0,00) |
| 64.334 | Repligen Corp | Morgan Stanley | (18.450) | (0,00) |
| 32.641 | Repligen Corp | Goldman Sachs International | (6.159) | (0,00) |
| (3.329) | Replimune Group Inc | Morgan Stanley | (2.615) | (0,00) |
| (791) | Republic Services Inc | Morgan Stanley | (361) | (0,00) |
| (6.615) | Resideo Technologies Inc | Morgan Stanley | (664) | (0,00) |
| 799 | ResMed Inc | Morgan Stanley | (2.476) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|----------|-------------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 355.268 | ResMed Inc | Goldman Sachs International | (36.880) | (0,01) |
| 43.524 | ResMed Inc | JPMorgan Chase Bank | (9.492) | (0,00) |
| (14.300) | Resolute Forest Products Inc | Morgan Stanley | (8.294) | (0,00) |
| 449 | Resources Connection Inc | Morgan Stanley | (24) | (0,00) |
| 780 | Restaurant Brands International Inc | Morgan Stanley | (39) | (0,00) |
| (286) | Retail Opportunity Investments Corp | Morgan Stanley | (15) | (0,00) |
| (94.915) | REVOLUTION Medicines Inc | Morgan Stanley | (11.199) | (0,00) |
| (251) | Revity Inc | Morgan Stanley | (272) | (0,00) |
| 40.109 | Rexford Industrial Realty Inc | Morgan Stanley | (8.214) | (0,00) |
| (1.459) | Rhythm Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (1.138) | (0,00) |
| 36.362 | Rightmove Plc | Goldman Sachs International | (1.706) | (0,00) |
| 36.810 | Rightmove Plc | JPMorgan Chase Bank | (3.519) | (0,00) |
| 40.197 | RingCentral Inc Class A | Morgan Stanley | (7.284) | (0,00) |
| 732 | Rithm Capital Corp | Morgan Stanley | (16) | (0,00) |
| 79.893 | Rivian Automotive Inc Class A | Morgan Stanley | (14.866) | (0,00) |
| (1.062) | Robert Half Inc | Morgan Stanley | (917) | (0,00) |
| 72.038 | Robinhood Markets Inc Class A | Morgan Stanley | (25.721) | (0,00) |
| (1.642) | ROBLOX Corp Class A | Morgan Stanley | (2.320) | (0,00) |
| 637.152 | Roche Holding AG | JPMorgan Chase Bank | (4.443) | (0,00) |
| 38.240 | Rocket Cos Inc Class A | Morgan Stanley | (22.433) | (0,00) |
| (2.894) | Rocket Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (4.286) | (0,00) |
| (77) | Rockwell Automation Inc | Morgan Stanley | (16) | (0,00) |
| (181) | Rogers Communications Inc | Morgan Stanley | (105) | (0,00) |
| 19.771 | Roivant Sciences Ltd | Morgan Stanley | (30.115) | (0,00) |
| 21.188 | Roku Inc | JPMorgan Chase Bank | (117) | (0,00) |
| (19) | Ross Stores Inc | Morgan Stanley | (10) | (0,00) |
| 36.247 | Royal Gold Inc | Morgan Stanley | (6.484) | (0,00) |
| 4.186 | Royalty Pharma Plc Class A | JPMorgan Chase Bank | (175) | (0,00) |
| 134.074 | RPC Inc | Morgan Stanley | (8.249) | (0,00) |
| 4.620 | RPM International Inc | Morgan Stanley | (944) | (0,00) |
| (39.541) | Ryan Specialty Holdings Inc | Morgan Stanley | (3.445) | (0,00) |
| 2.502 | Ryerson Holding Corp | Morgan Stanley | (1.680) | (0,00) |
| 64.169 | S&P Global Inc | Morgan Stanley | (23.361) | (0,00) |
| (6) | Safehold Inc | Morgan Stanley | (1) | (0,00) |
| (449) | Sage Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (213) | (0,00) |
| 41.973 | Saia Inc | Morgan Stanley | (6.684) | (0,00) |
| 43.715 | Salesforce Inc | JPMorgan Chase Bank | (13.169) | (0,00) |
| (2.490) | Sally Beauty Holdings Inc | Morgan Stanley | (276) | (0,00) |
| 134.010 | Sampo Oyj Class A | Goldman Sachs International | (10.392) | (0,00) |
| 832 | Samsara Inc Class A | Morgan Stanley | (250) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|---------------------------------------|-------------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 1.139 | SandRidge Energy Inc | Morgan Stanley | (435) | (0,00) |
| (150) | Sandstorm Gold Ltd | Morgan Stanley | (3) | (0,00) |
| (7.180) | Sanofi | Morgan Stanley | (480) | (0,00) |
| (191.928) | Sanofi | JPMorgan Chase Bank | (20.034) | (0,00) |
| 85.344 | SAP SE | Morgan Stanley | (13.415) | (0,00) |
| 10.000.000 | Sasol Financing USA LLC | Bank of America Merrill Lynch | (1.027.398) | (0,07) |
| 74.919 | SBA Communications Corp | Morgan Stanley | (2.404) | (0,00) |
| 119.390 | Schlumberger NV | Goldman Sachs International | (8.414) | (0,00) |
| (573) | Schneider National Inc Class B | Morgan Stanley | (69) | (0,00) |
| (7.479) | Scholar Rock Holding Corp | Morgan Stanley | (3.769) | (0,00) |
| (5.339) | Schrodinger Inc | Morgan Stanley | (4.951) | (0,00) |
| 105 | Scotts Miracle-Gro Co | Morgan Stanley | (15) | (0,00) |
| 658 | Seabridge Gold Inc | Morgan Stanley | (286) | (0,00) |
| 113.265 | Seagate Technology Holdings Plc | Morgan Stanley | (43.626) | (0,01) |
| 345.190 | SeaWorld Entertainment Inc | JPMorgan Chase Bank | (16.221) | (0,00) |
| 122 | Selective Insurance Group Inc | Morgan Stanley | (72) | (0,00) |
| 73.918 | Sempra | Morgan Stanley | (1.729) | (0,00) |
| (2.038) | Sensata Technologies Holding Plc | Morgan Stanley | (819) | (0,00) |
| 34.725 | SentinelOne Inc Class A | Morgan Stanley | (25.082) | (0,00) |
| (4.000) | Seritage Growth Properties | Morgan Stanley | (203) | (0,00) |
| (8.423) | Service Properties Trust | Morgan Stanley | (820) | (0,00) |
| (1.232.095) | Shell Plc | JPMorgan Chase Bank | (15.345) | (0,00) |
| 496 | Shift4 Payments Inc Class A | Morgan Stanley | (35) | (0,00) |
| 11.812 | Shoals Technologies Group Inc Class A | Morgan Stanley | (1.721) | (0,00) |
| (2.928) | Shoe Carnival Inc | Morgan Stanley | (2.965) | (0,00) |
| 3.384.606 | Shoprite Holdings Ltd | JPMorgan Chase Bank | (22.848) | (0,00) |
| 105 | Shyft Group Inc | Morgan Stanley | (48) | (0,00) |
| 524.085 | Sibanye Stillwater Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (0) | (0,00) |
| 42.005 | Silgan Holdings Inc | Morgan Stanley | (3.550) | (0,00) |
| (263) | Silicon Laboratories Inc | Morgan Stanley | (1.004) | (0,00) |
| (2.356) | Simply Good Foods Co | Morgan Stanley | (1.098) | (0,00) |
| (6.633) | SiriusPoint Ltd | Morgan Stanley | (564) | (0,00) |
| 20.262 | SITE Centers Corp | Morgan Stanley | (3.052) | (0,00) |
| 48.233 | SiteOne Landscape Supply Inc | Morgan Stanley | (1.509) | (0,00) |
| 3.370.389 | Skandinaviska Enskilda Banken AB | Goldman Sachs International | (38.224) | (0,01) |
| (283) | Skyline Champion Corp | Morgan Stanley | (3) | (0,00) |
| 53.956 | Skyworks Solutions Inc | Morgan Stanley | (7.301) | (0,00) |
| 2.784 | Sleep Number Corp | Morgan Stanley | (3.328) | (0,00) |
| 1.223 | SmartRent Inc | Morgan Stanley | (77) | (0,00) |
| (196.292) | Snam SpA | Goldman Sachs International | (222) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|---|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| (4.400.000) | Snam SpA | BNP Paribas | (431.682) | (0,03) |
| (8.189) | Snap Inc Class A | Morgan Stanley | (859) | (0,00) |
| 47.305 | Snowflake Inc Class A | Goldman Sachs International | (11.501) | (0,00) |
| (425) | Snowflake Inc Class A | Morgan Stanley | (1.084) | (0,00) |
| 25.549 | Snowflake Inc Class A | JPMorgan Chase Bank | (2.171) | (0,00) |
| 35.982 | SoFi Technologies Inc | Morgan Stanley | (14.086) | (0,00) |
| 725.861 | Sonos Inc | Morgan Stanley | (150.686) | (0,01) |
| (10.211) | Sotera Health Co | Morgan Stanley | (2.003) | (0,00) |
| 66.612 | Southern Co | Morgan Stanley | (355) | (0,00) |
| 71.480 | Southwest Airlines Co | Morgan Stanley | (10.264) | (0,00) |
| 431.615 | Southwest Airlines Co | Goldman Sachs International | (46.193) | (0,01) |
| 666.197 | Southwest Airlines Co | JPMorgan Chase Bank | (52.605) | (0,01) |
| (279.473) | Southwestern Energy Co | JPMorgan Chase Bank | (19.244) | (0,00) |
| (80.615) | Southwestern Energy Co | Morgan Stanley | (4.262) | (0,00) |
| (3.295) | Sphere Entertainment Co | Morgan Stanley | (97) | (0,00) |
| 25.456 | Spirit AeroSystems Holdings Inc Class A | Morgan Stanley | (24.039) | (0,00) |
| 28.452 | Spotify Technology SA | Goldman Sachs International | (1.267) | (0,00) |
| 2.221 | Spotify Technology SA | Morgan Stanley | (2.651) | (0,00) |
| 11.290 | SpringWorks Therapeutics Inc | JPMorgan Chase Bank | (2.910) | (0,00) |
| 7.074 | SpringWorks Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (2.937) | (0,00) |
| 1.865 | Sprout Social Inc Class A | Morgan Stanley | (5.754) | (0,00) |
| 32.736 | Sprout Social Inc Class A | JPMorgan Chase Bank | (5.099) | (0,00) |
| 534.835 | Sprouts Farmers Market Inc | Morgan Stanley | (75.899) | (0,01) |
| 913 | SSR Mining Inc | Morgan Stanley | (184) | (0,00) |
| 495 | STAG Industrial Inc | Morgan Stanley | (68) | (0,00) |
| 854 | Standard Motor Products Inc | Morgan Stanley | (674) | (0,00) |
| 546 | Stanley Black & Decker Inc | Morgan Stanley | (57) | (0,00) |
| (2.784) | Star Bulk Carriers Corp | Morgan Stanley | (502) | (0,00) |
| 1.866 | Starwood Property Trust Inc | Morgan Stanley | (213) | (0,00) |
| 149 | State Street Corp | Morgan Stanley | (17) | (0,00) |
| 351 | Steel Dynamics Inc | Morgan Stanley | (1.156) | (0,00) |
| 2.294 | Steelcase Inc Class A | Morgan Stanley | (929) | (0,00) |
| (2.964) | Stellantis NV | Morgan Stanley | (670) | (0,00) |
| (1.127) | STERIS Plc | Morgan Stanley | (3.341) | (0,00) |
| 6.196 | Stitch Fix Inc Class A | Morgan Stanley | (2.441) | (0,00) |
| (251) | StoneX Group Inc | Morgan Stanley | (1.174) | (0,00) |
| 569 | Stride Inc | Morgan Stanley | (226) | (0,00) |
| 628.076 | Stryker Corp | Goldman Sachs International | (9.733) | (0,00) |
| 66.896 | Sun Communities Inc | Morgan Stanley | (11.046) | (0,00) |
| 795 | Sun Country Airlines Holdings Inc | Morgan Stanley | (294) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|------------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| (1.208) | Sun Life Financial Inc | Morgan Stanley | (227) | (0,00) |
| (379.185) | Suncor Energy Inc | Morgan Stanley | (880) | (0,00) |
| (627.477) | Suncor Energy Inc | JPMorgan Chase Bank | (5.129) | (0,00) |
| (4.999) | Sunnova Energy International Inc | Morgan Stanley | (2.278) | (0,00) |
| (7.566) | Sunrun Inc | Morgan Stanley | (6.265) | (0,00) |
| 2.132.871 | Swedbank AB | Goldman Sachs International | (3.752) | (0,00) |
| 271.124 | Swiss Life Holding AG | Goldman Sachs International | (19.361) | (0,00) |
| 1.389 | Symbotic Inc | Morgan Stanley | (2.450) | (0,00) |
| (783) | Syndax Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (1.172) | (0,00) |
| 109 | Synopsys Inc | Morgan Stanley | (2.492) | (0,00) |
| 353.397 | Sysco Corp | JPMorgan Chase Bank | (16.630) | (0,00) |
| 9.096 | Sysco Corp | Morgan Stanley | (284) | (0,00) |
| 63.448 | Take-Two Interactive Software Inc | Morgan Stanley | (14.170) | (0,00) |
| 40.014 | Tandem Diabetes Care Inc | Morgan Stanley | (24.604) | (0,00) |
| (748.614) | Tapestry Inc | JPMorgan Chase Bank | (9.030) | (0,00) |
| 2.176 | Tapestry Inc | Morgan Stanley | (372) | (0,00) |
| 70.460 | Targa Resources Corp | Morgan Stanley | (2.959) | (0,00) |
| (6.308) | Target Hospitality Corp | Morgan Stanley | (3.683) | (0,00) |
| (4.864) | Taylor Morrison Home Corp | Morgan Stanley | (116) | (0,00) |
| (465) | TD SYNnex Corp | Morgan Stanley | (274) | (0,00) |
| (68.540) | TechnipFMC Plc | JPMorgan Chase Bank | (7.178) | (0,00) |
| 39.819 | TechnipFMC Plc | Morgan Stanley | (478) | (0,00) |
| 36.207 | Teladoc Health Inc | Morgan Stanley | (10.201) | (0,00) |
| 74.273 | Teledyne Technologies Inc | Morgan Stanley | (22.201) | (0,00) |
| 74.065 | Teleflex Inc | Morgan Stanley | (9.129) | (0,00) |
| (3.998) | Telephone & Data Systems Inc | Morgan Stanley | (32) | (0,00) |
| (10.740) | TELUS Corp | Morgan Stanley | (822) | (0,00) |
| 42.611 | Tempur Sealy International Inc | Morgan Stanley | (9.758) | (0,00) |
| 372.793 | Tencent Holdings Ltd | Morgan Stanley | (18.652) | (0,00) |
| (75.150) | Teradata Corp | Morgan Stanley | (3.416) | (0,00) |
| (1.805) | Teradyne Inc | Morgan Stanley | (6.258) | (0,00) |
| 295.893 | Terna Rete Elettrica Nazionale SpA | Goldman Sachs International | (7.183) | (0,00) |
| (753) | Terns Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (96) | (0,00) |
| 174 | Terreno Realty Corp | Morgan Stanley | (0) | (0,00) |
| 8.326 | Tetra Tech Inc | Morgan Stanley | (469) | (0,00) |
| 6.546 | TETRA Technologies Inc | Morgan Stanley | (1.020) | (0,00) |
| 114.573 | Texas Instruments Inc | Morgan Stanley | (5.148) | (0,00) |
| (130.512) | Texas Pacific Land Corp | Morgan Stanley | (12.189) | (0,00) |
| 27.858 | Texas Roadhouse Inc | Morgan Stanley | (5.601) | (0,00) |
| 364 | Textron Inc | Morgan Stanley | (52) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 39.497 | TFS Financial Corp | Morgan Stanley | (3.668) | (0,00) |
| 15.005 | TG Therapeutics Inc | Goldman Sachs International | (16.045) | (0,00) |
| 3.918 | TG Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (2.363) | (0,00) |
| 73.400 | Thermo Fisher Scientific Inc | Morgan Stanley | (7.188) | (0,00) |
| 163.640 | Timken Co | Goldman Sachs International | (754) | (0,00) |
| 70.635 | Timken Co | JPMorgan Chase Bank | (1.075) | (0,00) |
| 1.440.866 | TJX Cos Inc | JPMorgan Chase Bank | (82.796) | (0,01) |
| (2.145) | TJX Cos Inc | Morgan Stanley | (2.111) | (0,00) |
| 3.615 | T-Mobile US Inc | JPMorgan Chase Bank | (50) | (0,00) |
| 72.520 | T-Mobile US Inc | Morgan Stanley | (8.504) | (0,00) |
| 116.777 | T-Mobile US Inc | Goldman Sachs International | (8.297) | (0,00) |
| 82.964 | Toast Inc Class A | Morgan Stanley | (2.396) | (0,00) |
| 592 | Toll Brothers Inc | Morgan Stanley | (573) | (0,00) |
| (9.825) | Topgolf Callaway Brands Corp | Morgan Stanley | (1.707) | (0,00) |
| 140 | TORM Plc Class A | Morgan Stanley | (45) | (0,00) |
| 74.185 | Toro Co | Morgan Stanley | (11.865) | (0,00) |
| (4.444) | Toronto-Dominion Bank | Morgan Stanley | (5.820) | (0,00) |
| 15 | TPG Inc | Morgan Stanley | (8) | (0,00) |
| 807 | TPG RE Finance Trust Inc | Morgan Stanley | (263) | (0,00) |
| 72.692 | Tractor Supply Co | Morgan Stanley | (10.711) | (0,00) |
| 175.699 | Tractor Supply Co | Goldman Sachs International | (4.729) | (0,00) |
| 1.458.372 | Tractor Supply Co | JPMorgan Chase Bank | (104.689) | (0,02) |
| 2.147 | Trade Desk Inc Class A | Morgan Stanley | (9.335) | (0,00) |
| 61.242 | Tradeweb Markets Inc Class A | Morgan Stanley | (9.082) | (0,00) |
| 65.138 | Trane Technologies Plc | Morgan Stanley | (16.895) | (0,00) |
| 577.842 | Trane Technologies Plc | JPMorgan Chase Bank | (10.462) | (0,00) |
| (2.191) | TransMedics Group Inc | Morgan Stanley | (1.632) | (0,00) |
| 53.283 | TransUnion | Morgan Stanley | (32.031) | (0,01) |
| (35.230) | TransUnion | Goldman Sachs International | (901) | (0,00) |
| 41.625 | Travel + Leisure Co | Morgan Stanley | (5.482) | (0,00) |
| 74.525 | Travelers Cos Inc | Morgan Stanley | (5.439) | (0,00) |
| (229.720) | TreeHouse Foods Inc | Goldman Sachs International | (41.506) | (0,01) |
| (785) | TreeHouse Foods Inc | Morgan Stanley | (858) | (0,00) |
| 1.327 | TriMas Corp | Morgan Stanley | (1.138) | (0,00) |
| 73.492 | Trimble Inc | Morgan Stanley | (11.855) | (0,00) |
| 46.725 | Trinet Group Inc | Goldman Sachs International | (2.569) | (0,00) |
| 106.804 | Trinet Group Inc | JPMorgan Chase Bank | (7.470) | (0,00) |
| 18.120 | TripAdvisor Inc | JPMorgan Chase Bank | (7.029) | (0,00) |
| 457 | TripAdvisor Inc | Morgan Stanley | (41) | (0,00) |
| (9.995) | Tronox Holdings Plc Class A | Morgan Stanley | (2.097) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|---------------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 1.160 | TrueBlue Inc | Morgan Stanley | (492) | (0,00) |
| 71.366 | Truist Financial Corp | Morgan Stanley | (11.861) | (0,00) |
| 2.601 | Trupanion Inc | Morgan Stanley | (3.700) | (0,00) |
| 268 | TTEC Holdings Inc | Morgan Stanley | (21) | (0,00) |
| 1.495 | TTM Technologies Inc | Morgan Stanley | (153) | (0,00) |
| 15.993 | Twelve Seas Investment Company II | Goldman Sachs International | (173) | (0,00) |
| 865 | Two Harbors Investment Corp | Morgan Stanley | (244) | (0,00) |
| 69.435 | Tyler Technologies Inc | Morgan Stanley | (6.898) | (0,00) |
| 65.837 | Tyson Foods Inc Class A | Morgan Stanley | (27.127) | (0,00) |
| 58.425 | Uber Technologies Inc | Morgan Stanley | (21.770) | (0,00) |
| 27.389 | UCB SA | Goldman Sachs International | (1.585) | (0,00) |
| 14.002 | Udemy Inc | Morgan Stanley | (4.577) | (0,00) |
| 37.373 | U-Haul Holding Co | Morgan Stanley | (22.491) | (0,00) |
| 60.026 | UiPath Inc Class A | Morgan Stanley | (29.684) | (0,00) |
| 59.065 | UiPath Inc Class A | JPMorgan Chase Bank | (27.259) | (0,00) |
| 289.854 | Ulta Beauty Inc | Goldman Sachs International | (54.395) | (0,01) |
| 534.729 | Ulta Beauty Inc | JPMorgan Chase Bank | (10.006) | (0,00) |
| 1.123.305 | Ulta Beauty Inc | Morgan Stanley | (172.518) | (0,01) |
| 36.871 | Ultragenyx Pharmaceutical Inc | Morgan Stanley | (14.631) | (0,00) |
| 1.858 | United Airlines Holdings Inc | Morgan Stanley | (1.282) | (0,00) |
| 2.336 | United Bankshares Inc | Morgan Stanley | (1.567) | (0,00) |
| 2.113 | United Community Banks Inc | Morgan Stanley | (956) | (0,00) |
| 1.634 | United Fire Group Inc | Morgan Stanley | (532) | (0,00) |
| 1.965.943 | United Parcel Service Inc Class B | Goldman Sachs International | (80.826) | (0,01) |
| 20.419 | United Parcel Service Inc Class B | Morgan Stanley | (7.527) | (0,00) |
| (289) | United Rentals Inc | Morgan Stanley | (1.593) | (0,00) |
| 258.547 | United Rentals Inc | JPMorgan Chase Bank | (51.705) | (0,01) |
| (1.701) | United States Steel Corp | Morgan Stanley | (1.217) | (0,00) |
| (168.802) | United Therapeutics Corp | JPMorgan Chase Bank | (914) | (0,00) |
| (40.788) | United Therapeutics Corp | Morgan Stanley | (294) | (0,00) |
| (750.750) | UnitedHealth Group Inc | Goldman Sachs International | (2.481) | (0,00) |
| 51.801 | Unity Software Inc | JPMorgan Chase Bank | (15.294) | (0,00) |
| 49.486 | Unity Software Inc | Morgan Stanley | (53.215) | (0,01) |
| 40.521 | Universal Display Corp | Morgan Stanley | (7.976) | (0,00) |
| 620.408 | Universal Health Services Inc Class B | Goldman Sachs International | (27.301) | (0,00) |
| (95.648) | Unum Group | Morgan Stanley | (5.926) | (0,00) |
| 2.876 | Upstart Holdings Inc | Morgan Stanley | (13.749) | (0,00) |
| 2.088 | Upwork Inc | Morgan Stanley | (138) | (0,00) |
| (10.904) | Uranium Energy Corp | Morgan Stanley | (407) | (0,00) |
| 20.263 | Urban Edge Properties | Morgan Stanley | (3.753) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|----------|--------------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 923.151 | Urban Outfitters Inc | JPMorgan Chase Bank | (7.339) | (0,00) |
| 125 | Urban Outfitters Inc | Morgan Stanley | (70) | (0,00) |
| 61.408 | US Bancorp | Morgan Stanley | (22.222) | (0,00) |
| 341 | US Silica Holdings Inc | Morgan Stanley | (17) | (0,00) |
| 80.737 | USANA Health Sciences Inc | Goldman Sachs International | (13.154) | (0,00) |
| 89.002 | USANA Health Sciences Inc | JPMorgan Chase Bank | (14.620) | (0,00) |
| (8.052) | Utz Brands Inc | Morgan Stanley | (7.076) | (0,00) |
| (695) | V2X Inc | Morgan Stanley | (575) | (0,00) |
| (1.297) | Valaris Ltd | Morgan Stanley | (11) | (0,00) |
| 7.045 | Valley National Bancorp | Morgan Stanley | (921) | (0,00) |
| 671 | Valvoline Inc | Morgan Stanley | (10) | (0,00) |
| 67 | Varonis Systems Inc | Morgan Stanley | (24) | (0,00) |
| (3.295) | Vaxcyte Inc | Morgan Stanley | (8.349) | (0,00) |
| (1.900) | Vector Group Ltd | Morgan Stanley | (40) | (0,00) |
| (2.468) | Veeco Instruments Inc | Morgan Stanley | (1.056) | (0,00) |
| 73.051 | Ventas Inc | Morgan Stanley | (7.145) | (0,00) |
| 267 | Veracyte Inc | Morgan Stanley | (134) | (0,00) |
| 2.505 | Verint Systems Inc | Morgan Stanley | (1.774) | (0,00) |
| (52.532) | Verisk Analytics Inc | Goldman Sachs International | (441) | (0,00) |
| (776) | Verisk Analytics Inc | Morgan Stanley | (2.858) | (0,00) |
| 59.762 | Verizon Communications Inc | JPMorgan Chase Bank | (4.647) | (0,00) |
| 63.561 | Verizon Communications Inc | Morgan Stanley | (7.307) | (0,00) |
| 8.677 | Verizon Communications Inc | Goldman Sachs International | (21) | (0,00) |
| 320 | Vermillion Energy Inc | Morgan Stanley | (54) | (0,00) |
| (527) | Verra Mobility Corp | Morgan Stanley | (54) | (0,00) |
| 120.816 | Vertex Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs International | (22.057) | (0,00) |
| 531.534 | Vertex Pharmaceuticals Inc | JPMorgan Chase Bank | (1.399) | (0,00) |
| (4.740) | Vertiv Holdings Co Class A | Morgan Stanley | (89) | (0,00) |
| 65.648 | VF Corp | Morgan Stanley | (9.627) | (0,00) |
| 25.843 | Viasat Inc | Morgan Stanley | (38.393) | (0,00) |
| (57.685) | Viatis Inc | Morgan Stanley | (18.732) | (0,00) |
| (1.586) | Viavi Solutions Inc | Morgan Stanley | (317) | (0,00) |
| 9.090 | VICI Properties Inc | Morgan Stanley | (831) | (0,00) |
| 5.634 | Victoria's Secret & Co | Morgan Stanley | (548) | (0,00) |
| 37 | Victory Capital Holdings Inc Class A | Morgan Stanley | (18) | (0,00) |
| (5.114) | Viking Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (3.533) | (0,00) |
| (11.040) | Vir Biotechnology Inc | Morgan Stanley | (2.888) | (0,00) |
| (7.454) | Viridian Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (4.082) | (0,00) |
| 359 | Virtu Financial Inc Class A | Morgan Stanley | (30) | (0,00) |
| 496.513 | Visa Inc Class A | JPMorgan Chase Bank | (35.933) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|--|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 13.644 | Visa Inc Class A | Goldman Sachs International | (102) | (0,00) |
| 152.584 | Visa Inc Class A | Morgan Stanley | (22.494) | (0,00) |
| 104 | Visteon Corp | Morgan Stanley | (289) | (0,00) |
| (14.779) | Vistra Corp | Morgan Stanley | (9.448) | (0,00) |
| 1.580 | Vita Coco Co Inc | Morgan Stanley | (821) | (0,00) |
| 295 | Vital Energy Inc | Morgan Stanley | (83) | (0,00) |
| 2.972 | Vivid Seats Inc Class A | Morgan Stanley | (168) | (0,00) |
| 1.084.578 | Vodacom Group Ltd | Goldman Sachs International | (969) | (0,00) |
| 1.197.381 | Vodacom Group Ltd | Morgan Stanley | (157) | (0,00) |
| 38.732 | Vornado Realty Trust | Morgan Stanley | (10.073) | (0,00) |
| 69.203 | Vulcan Materials Co | Morgan Stanley | (11.322) | (0,00) |
| (214) | WaFd Inc | Morgan Stanley | (118) | (0,00) |
| (11.526) | Walgreens Boots Alliance Inc | Morgan Stanley | (4.010) | (0,00) |
| (88.430) | Walt Disney Co | JPMorgan Chase Bank | (2.980) | (0,00) |
| (26.878) | Walt Disney Co | Morgan Stanley | (393) | (0,00) |
| 66.353 | Warner Bros Discovery Inc | Morgan Stanley | (6.504) | (0,00) |
| (2.671) | Waste Management Inc | Morgan Stanley | (6.833) | (0,00) |
| (434) | Waters Corp | Morgan Stanley | (896) | (0,00) |
| 72.732 | Watsco Inc | Morgan Stanley | (10.625) | (0,00) |
| 2.974 | Wayfair Inc Class A | Morgan Stanley | (48.578) | (0,00) |
| (6.529) | Wayfair Inc Class A | JPMorgan Chase Bank | (216) | (0,00) |
| (34.262) | Wayfair Inc Class A | Goldman Sachs International | (1.120) | (0,00) |
| 64.341 | WEC Energy Group Inc | Morgan Stanley | (9.343) | (0,00) |
| 3.052 | Wells Fargo & Co | Morgan Stanley | (1.177) | (0,00) |
| 68.494 | Welltower Inc | Morgan Stanley | (7.669) | (0,00) |
| (4.200.000) | Wendel SE | BNP Paribas | (305.788) | (0,02) |
| 707.360 | West Pharmaceutical Services Inc | Goldman Sachs International | (849) | (0,00) |
| 59.431 | Western Digital Corp | Morgan Stanley | (37.037) | (0,00) |
| (32.459) | Western Union Co | JPMorgan Chase Bank | (3.761) | (0,00) |
| (84.873) | Western Union Co | Morgan Stanley | (6.009) | (0,00) |
| (21.742) | Western Union Co | Goldman Sachs International | (547) | (0,00) |
| (997) | Westinghouse Air Brake Technologies Corp | Morgan Stanley | (433) | (0,00) |
| 70.412 | Westlake Corp | Morgan Stanley | (10.324) | (0,00) |
| (11.963) | Weyerhaeuser Co | Morgan Stanley | (5.256) | (0,00) |
| 128 | Wheaton Precious Metals Corp | Morgan Stanley | (91) | (0,00) |
| 146 | Whirlpool Corp | Morgan Stanley | (142) | (0,00) |
| 65.872 | Williams Cos Inc | Morgan Stanley | (3.953) | (0,00) |
| 182.149 | Williams Cos Inc | JPMorgan Chase Bank | (1.040) | (0,00) |
| 690.936 | Williams-Sonoma Inc | Morgan Stanley | (358.943) | (0,03) |
| 64.611 | Willis Towers Watson Plc | Morgan Stanley | (10.332) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|------------------------------------|-------------------------------|---------------------------------|----------------------|
| (110) | WillScot Mobile Mini Holdings Corp | Morgan Stanley | (1) | (0,00) |
| 1.558 | WisdomTree Inc | Morgan Stanley | (316) | (0,00) |
| 79.557 | WK Kellogg Co | Goldman Sachs International | (12.209) | (0,00) |
| 205.519 | WK Kellogg Co | JPMorgan Chase Bank | (28.346) | (0,00) |
| 66.514 | Wolfspeed Inc | Morgan Stanley | (20.271) | (0,00) |
| 902 | Wolverine World Wide Inc | Morgan Stanley | (145) | (0,00) |
| 2.737 | Woodward Inc | Morgan Stanley | (334) | (0,00) |
| 88.934 | Workday Inc Class A | Morgan Stanley | (23.015) | (0,00) |
| 54.386 | Workday Inc Class A | Goldman Sachs International | (6.402) | (0,00) |
| 7.576 | Workday Inc Class A | JPMorgan Chase Bank | (126) | (0,00) |
| 100 | Workiva Inc | Morgan Stanley | (35) | (0,00) |
| 63.469 | WP Carey Inc | Morgan Stanley | (14.850) | (0,00) |
| 68.914 | WR Berkley Corp | Morgan Stanley | (2.893) | (0,00) |
| 12.134 | WW International Inc | Morgan Stanley | (1.877) | (0,00) |
| (723.886) | Wynn Resorts Ltd | Morgan Stanley | (85.457) | (0,01) |
| 41.042 | Xcel Energy Inc | Morgan Stanley | (1.229) | (0,00) |
| 54 | Xenia Hotels & Resorts Inc | Morgan Stanley | (8) | (0,00) |
| (4.456) | Xenon Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (22.197) | (0,00) |
| 63.582 | Xylem Inc | Morgan Stanley | (18.264) | (0,00) |
| 5.600.000 | Yeahka Ltd | Nomura | (120.501) | (0,01) |
| 5.377 | Yelp Inc | Morgan Stanley | (2.504) | (0,00) |
| 53 | YETI Holdings Inc | Morgan Stanley | (6) | (0,00) |
| (4.272) | Yum! Brands Inc | Morgan Stanley | (2.578) | (0,00) |
| (39.584) | Zai Lab Ltd | Goldman Sachs International | (1.984) | (0,00) |
| (163.140) | Zai Lab Ltd | JPMorgan Chase Bank | (11.058) | (0,00) |
| 309.877 | Zalando SE | Goldman Sachs International | (973) | (0,00) |
| 435.014 | Zalando SE | JPMorgan Chase Bank | (1.105) | (0,00) |
| 71.121 | Zebra Technologies Corp Class A | Morgan Stanley | (17.794) | (0,00) |
| (3.258) | Zentalis Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (3.670) | (0,00) |
| 76.216 | Zillow Group Inc Class C | Morgan Stanley | (23.884) | (0,00) |
| (43.564) | Zimmer Biomet Holdings Inc | JPMorgan Chase Bank | (5.906) | (0,00) |
| (38.366) | Zimmer Biomet Holdings Inc | Goldman Sachs International | (3.846) | (0,00) |
| 6.452 | ZipRecruiter Inc Class A | Morgan Stanley | (1.875) | (0,00) |
| 51.204 | Zoetis Inc | Goldman Sachs International | (11.831) | (0,00) |
| 68.132 | ZoomInfo Technologies Inc | Morgan Stanley | (13.984) | (0,00) |
| 15.000.000 | ZTO Express Cayman Inc | Bank of America Merrill Lynch | (20.756) | (0,00) |
| 392.662 | Zurich Insurance Group AG | Goldman Sachs International | (28.525) | (0,00) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Differenzkontrakten [∞] | | | (20.691.238) | (1,26) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Swaptions (0,00 %) (31. Dezember 2022: (0,02 %))

| Anzahl Kontrakte | Fälligkeit | Beschreibung | Gegenpartei | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|------------|---|---------------------|-----------------|----------------------|
| Put-Swaptions | | | | | |
| (525.000.000) EUR | 17.01.2024 | EUR Swaption, upon potential exercise of the option, the Portfolio will enter into swap with the notional value of EUR 525,000,000, in which it will pay a rate of 1.00%, and will receive iTraxx EUR S40, strike 1.05% | JPMorgan Chase Bank | (29.043) | (0,00) |
| Beizulegender Zeitwert aus verkauften Swaptions insgesamt [⊖] (Prämie: 213.915 US\$) | | | | (29.043) | (0,00) |

Credit-Default-Swap-Kontrakte (0,08 %) (31. Dezember 2022: (0,02 %))

| Nominalwert | Datum der Schließung | Gegenpartei | Referenz-obligation | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|---|----------------------|-----------------------------|---|--------------------|----------------------|
| 13.000.000 EUR | 20.12.2024 | Nomura International Plc | Buying default protection on POSCO Holdings Inc, 2.75%, 15/07/2024 | (93.101) | (0,01) |
| 5.800.000 USD | 20.12.2026 | JPMorgan Chase Bank | Buying default protection on Simon Property Group LP, 2.65%, 15/07/2030 | (84.626) | (0,00) |
| 5.000.000 EUR | 20.06.2026 | BNP Paribas | Buying default protection on Cellnex Telecom SA, 2.36%, 16/01/2024 | (591.535) | (0,04) |
| 10.000.000 EUR | 20.06.2028 | BNP Paribas | Buying default protection on Eni SpA, 1.75%, 18/01/2024 | (238.107) | (0,01) |
| 1.250.000.000 JPY | 20.06.2025 | JPMorgan Chase Bank | Buying default protection on ANA Holdings Inc, 1.22%, 06/03/2024 | (110.696) | (0,01) |
| 500.000.000 JPY | 20.12.2026 | Goldman Sachs International | Buying default protection on ANA Holdings Inc, 1.22%, 06/03/2024 | (75.118) | (0,00) |
| 750.000.000 JPY | 20.12.2026 | JPMorgan Chase Bank | Buying default protection on ANA Holdings Inc, 1.22%, 06/03/2024 | (112.677) | (0,01) |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt [*] | | | | (1.305.860) | (0,08) |

Zinsswap-Kontrakte (0,56 %) (31. Dezember 2022: 0,76 %)

| Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei | Erhalt/(Zahlung) [#] | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------------|------------|-------------------------------|-------------------------------|-----------------|--------------------|---------------------------------|----------------------|
| ZAR 2.000 | 20.12.2033 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 9,59 % | 3M JIBAR | (3) | (0,00) |
| PLN 10.000 | 20.09.2033 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 4,83 % | 6M WIBOR | (71) | (0,00) |
| PLN 30.000 | 15.12.2024 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 1,44 % | 6M WIBOR | (290) | (0,00) |
| ZAR 121.510.000 | 20.12.2025 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 7,78 % | 3M JIBAR | (267) | (0,00) |
| ZAR 108.820.000 | 20.12.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 8,07 % | 3M JIBAR | (6.165) | (0,00) |
| ZAR 36.940.000 | 20.12.2033 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 9,23 % | 3M JIBAR | (14.505) | (0,00) |
| EUR 1.000.000.000 | 18.09.2024 | Merrill Lynch International | Erhalt | 3,70 % | 6M €STR | (16.680) | (0,00) |
| EUR 1.000.000.000 | 18.09.2024 | Merrill Lynch International | Erhalt | 3,73 % | 6M €STR | (16.680) | (0,00) |
| ZAR 46.900.000 | 20.03.2034 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 9,31 % | 3M JIBAR | (20.797) | (0,00) |
| CAD 49.379.000 | 20.03.2029 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 3,05 % | 12M CDOR | (48.414) | (0,00) |
| USD 7.400.000 | 18.12.2054 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 3,27 % | 1D SOFR | (54.306) | (0,00) |
| CZK 3.487.500.000 | 25.04.2024 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 6,55 % | 1D PRIBOR | (59.129) | (0,00) |
| ZAR 234.500.000 | 20.03.2034 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 9,26 % | 3M JIBAR | (62.355) | (0,01) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Zinsswap-Kontrakte (0,56) % (31. Dezember 2022: 0,76 %) (Fortsetzung)

| Nominalwert | Fällig- keit | Gegenpartei | Erhalt/(Zahlung) [#] | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Netto- vermögens |
|---|-----------------|---|-------------------------------|--------------------|--------------------|---------------------------------------|---------------------------|
| CZK 3.525.000.000 | 25.04.2024 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 6,32 % | 1D PRIBOR | (149.658) | (0,01) |
| CZK 3.502.500.000 | 25.04.2024 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 6,30 % | 1D PRIBOR | (156.470) | (0,01) |
| MXN 1.625.000.000 | 16.12.2026 | Chicago Mercantile Exchange ¹ | Erhalt | 9,18 % | 28D MXIBTIE | (177.291) | (0,01) |
| USD 11.390.000 | 18.12.2054 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 3,34 % | 1D SOFR | (227.963) | (0,02) |
| USD 19.800.000 | 08.09.2033 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 3,75 % | 1D SOFR | (270.170) | (0,02) |
| JPY 2.698.000.000 | 20.09.2033 | LCH Clearnet Ltd ¹ | (Zahlung) | 0,65 % | 12M JPY LIBOR | (350.480) | (0,02) |
| HUF 1.633.000.000 | 20.12.2028 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 7,50 % | 6M BUBOR | (359.395) | (0,02) |
| EUR 62.000.000 | 15.02.2033 | Merrill Lynch International | (Zahlung) | 2,15 % | 1D €STR | (581.877) | (0,04) |
| SEK 138.592.000 | 20.03.2034 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 3,16 % | 3M STIBOR | (1.019.692) | (0,06) |
| EUR 1.025.000.000 | 20.03.2024 | Merrill Lynch International | (Zahlung) | 3,38 % | 3M €STR | (1.518.913) | (0,09) |
| SEK 233.590.000 | 20.03.2034 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 3,19 % | 3M STIBOR | (1.765.531) | (0,11) |
| SEK 240.300.000 | 20.03.2034 | LCH Clearnet Ltd ¹ | Erhalt | 3,37 % | 3M STIBOR | (2.212.635) | (0,14) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten [∞] | | | | | | (9.089.737) | (0,56) |

[#]Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

¹Zentral abgewickelter Swap.

Total Return Swap-Kontrakte (0,20) % (31. Dezember 2022: (0,04) %)

| Nominalwert | Datum der Schließung | Variabler Zinssatz | Referenzunternehmen | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Netto- vermögens |
|-----------------|-------------------------|--------------------|---|------------------------------------|---------------------------|
| 172.027.668 HKD | 04.12.2025 | 5,62 ¹ | Goldman Sachs Basket GSCBIHKT ² | (61) | (0,00) |
| (6.392) USD | 06.11.2024 | 5,11 ³ | Morgan Stanley Basket MSNBUSPY ⁴ | (643) | (0,00) |
| (58.119) USD | 06.11.2024 | 5,02 ³ | Morgan Stanley Basket MSNBUIGV ⁴ | (1.506) | (0,00) |
| (58.138) USD | 06.11.2024 | 5,03 ³ | Morgan Stanley Basket MSNBUXLK ⁴ | (2.046) | (0,00) |
| (57.947) USD | 06.11.2024 | 5,11 ³ | Morgan Stanley Basket MSNBUSPY ⁴ | (2.328) | (0,00) |
| (58.241) USD | 06.11.2024 | 5,11 ³ | Morgan Stanley Basket MSNBUSPY ⁴ | (2.743) | (0,00) |
| (735.963) USD | 06.11.2024 | 5,11 ³ | Morgan Stanley Basket MSNBUSPY ⁴ | (5.864) | (0,00) |
| (291.217) USD | 06.11.2024 | 5,08 ³ | Morgan Stanley Basket MSNBUXLV ⁴ | (7.901) | (0,00) |
| (179.512) USD | 06.11.2024 | 5,11 ³ | Morgan Stanley Basket MSNBUSPY ⁴ | (8.349) | (0,00) |
| (562.570) USD | 06.11.2024 | 5,11 ³ | Morgan Stanley Basket MSNBUXLP ⁴ | (9.177) | (0,00) |
| (945.631) USD | 06.11.2024 | 5,11 ³ | Morgan Stanley Basket MSABHLTH ⁴ | (11.386) | (0,00) |
| (396.552) USD | 19.07.2024 | 4,53 ³ | Morgan Stanley Basket MSCBSBTU ⁴ | (16.414) | (0,00) |
| (212.865) USD | 06.11.2024 | 5,03 ³ | Morgan Stanley Basket MSNBUXLK ⁴ | (16.685) | (0,00) |
| (507.899) USD | 06.11.2024 | 5,08 ³ | Morgan Stanley Basket MSXXSTAP ⁴ | (17.244) | (0,00) |
| (196.090) USD | 06.11.2024 | 5,76 ³ | Morgan Stanley Basket MSNBUIWM ⁴ | (18.616) | (0,00) |
| (135.934) USD | 06.11.2024 | 4,99 ³ | Morgan Stanley Basket MSNBUSMH ⁴ | (22.509) | (0,00) |
| (274.381) USD | 06.11.2024 | 5,76 ³ | Morgan Stanley Basket MSNBUXBI ⁴ | (26.812) | (0,00) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Total Return Swap-Kontrakte (0,20 %) (31. Dezember 2022: (0,04 %)) (Fortsetzung)

| Nominalwert | Datum der Schließung | Variabler Zinssatz | Referenzunternehmen | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|----------------------|--------------------|---|---------------------------------|----------------------|
| (612.240) USD | 06.11.2024 | 5,76 ³ | Morgan Stanley Basket MSNBUIWM ⁴ | (30.573) | (0,00) |
| (356.635) USD | 06.11.2024 | 5,03 ³ | Morgan Stanley Basket MSNBUXLC ⁴ | (31.710) | (0,00) |
| (363.511) EUR | 12.11.2025 | 3,38 ⁵ | Morgan Stanley Basket MSABESHQ ⁴ | (33.777) | (0,00) |
| (902.075) USD | 06.11.2024 | 5,11 ³ | Morgan Stanley Basket MSNBUSPY ⁴ | (34.194) | (0,00) |
| (560.375) EUR | 19.08.2024 | 3,60 ⁶ | JPMorgan Basket JPAYMCPH ⁷ | (34.530) | (0,00) |
| (667.431) EUR | 12.06.2024 | 3,60 ⁶ | JPMorgan Basket JPECND ⁷ | (42.937) | (0,00) |
| (490.834) USD | 05.03.2025 | 4,51 ³ | Morgan Stanley Basket MSACWLUP ⁴ | (49.034) | (0,00) |
| (548.466) USD | 06.11.2024 | 5,76 ³ | Morgan Stanley Basket MSNBUIWM ⁴ | (49.682) | (0,00) |
| 1.521.138 USD | 09.02.2024 | 5,13 ⁸ | JPMorgan Basket JPSOBRKE ⁷ | (51.944) | (0,00) |
| (115.207) USD | 21.03.2024 | 5,58 ³ | Goldman Sachs Basket GSUCPSL2 ² | (57.981) | (0,00) |
| (978.287) USD | 06.11.2024 | 5,02 ³ | Morgan Stanley Basket MSNBUXRT ⁴ | (61.831) | (0,01) |
| (623.577) USD | 06.11.2024 | 5,11 ³ | Morgan Stanley Basket MSNBUIQQ ⁴ | (65.398) | (0,01) |
| (508.787) USD | 06.11.2024 | 5,02 ³ | Morgan Stanley Basket MSNBUXRT ⁴ | (65.731) | (0,01) |
| (653.544) USD | 06.11.2024 | 5,03 ³ | Morgan Stanley Basket MSNBUXLY ⁴ | (70.092) | (0,01) |
| (801.593) USD | 06.11.2024 | 5,11 ³ | Morgan Stanley Basket MSNBUSPY ⁴ | (82.262) | (0,01) |
| (776.610) USD | 06.11.2024 | 5,11 ³ | Morgan Stanley Basket MSNBUIQQ ⁴ | (86.023) | (0,01) |
| (573.836) USD | 06.11.2024 | 5,02 ³ | Morgan Stanley Basket MSNBUXRT ⁴ | (111.862) | (0,01) |
| (1.041.706) USD | 06.11.2024 | 5,03 ³ | Morgan Stanley Basket MSNBUXLK ⁴ | (127.315) | (0,01) |
| (1.238.485) USD | 06.11.2024 | 5,03 ³ | Morgan Stanley Basket MSNBUXLC ⁴ | (138.019) | (0,01) |
| (1.358.074) USD | 06.11.2024 | 5,11 ³ | Morgan Stanley Basket MSNBUSPY ⁴ | (160.260) | (0,01) |
| (855.523) USD | 06.11.2024 | 5,76 ³ | Morgan Stanley Basket MSNBUIWM ⁴ | (162.113) | (0,01) |
| (1.984.944) USD | 06.11.2024 | 5,11 ³ | Morgan Stanley Basket MSNBUSPY ⁴ | (196.557) | (0,01) |
| 35.000.160 HKD | 22.03.2024 | 5,62 ¹ | JPMorgan Basket JPSOCINS ⁷ | (260.639) | (0,02) |
| (1.655.868) USD | 06.11.2024 | 5,76 ³ | Morgan Stanley Basket MSNBUXBI ⁴ | (388.192) | (0,03) |
| (1.648.509) USD | 06.11.2024 | 5,06 ³ | Morgan Stanley Basket MSABSMBP ⁴ | (458.226) | (0,03) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Total Return Swap-Kontrakten [∞] | | | | (3.021.166) | (0,20) |

¹ Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist der Ein-Monats-HIBOR.

² Die Gegenpartei für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist Goldman Sachs International.

³ Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist der 1-Tag-FEDEF.

⁴ Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist Morgan Stanley.

⁵ Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist der 1-Monat-EURIBOR.

⁶ Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist der 1-Tag-ESTR.

⁷ Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist die JPMorgan Chase Bank.

⁸ Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist der 1-Tag-SOFR.

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Inflation-Swap-Kontrakte (0,03 %) (31. Dezember 2022: (0,01 %))

| Vega Nominalwert | Datum der Schließung | Gegenpartei | Referenz-obligation | Variance-Ausübungssatz | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|----------------------|-----------------------------|---------------------------------------|------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 400.000 USD | 20.12.2024 | UBS | UBS 38 Names US Basket | Verschiedene | (12.744) | (0,00) |
| 250.000 EUR | 20.06.2025 | BNP Paribas | FTSE MIB Index vs Euro Stoxx 50 Index | 34,0 / 33,0 | (22.755) | (0,00) |
| 750.000 USD | 19.12.2025 | BNP Paribas | FTSE MIB Index vs S&P 500 Index | 24,60 / 27,95 | (23.344) | (0,00) |
| 300.000 USD | 20.12.2024 | UBS | UBS 24 Names US Basket | Verschiedene | (37.161) | (0,00) |
| 125.000 USD | 21.06.2024 | Goldman Sachs International | GS 34 Names Global Basket | Verschiedene | (418.672) | (0,03) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Inflation-Swap-Kontrakten [∞] | | | | | (514.676) | (0,03) |

Volatility-Swap-Kontrakte (0,56 %) (31. Dezember 2022: (0,14 %))

| Nominalwert | Datum der Schließung | Gegenpartei | Referenzobligation ¹ | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|----------------|----------------------|---------------------|--|---------------------------------|----------------------|
| 3.750.000 EUR | 20.12.2024 | BNP | BNP 20 Names EU Basket | (838) | (0,00) |
| 15.000.000 USD | 17.01.2025 | BofA Securities | BAML 17 Names US Basket | (6.694) | (0,00) |
| 15.000.000 USD | 17.01.2025 | BofA Securities | BAML 14 Names US Basket | (20.978) | (0,00) |
| 9.513.000 EUR | 21.06.2024 | Société Générale | SG 15 Names Global Basket | (29.825) | (0,00) |
| 40.000.000 USD | 17.01.2025 | Citibank NA | CITI 24 Names US Basket | (42.419) | (0,00) |
| 14.830.000 USD | 20.06.2025 | Morgan Stanley | CITI 31 Names Global Basket | (49.835) | (0,00) |
| 35.000.000 EUR | 20.12.2024 | Société Générale | SG 12 Names EU Basket | (50.261) | (0,00) |
| 30.000.000 USD | 20.06.2025 | Nomura | Nomura 20 Names Global Basket | (62.138) | (0,00) |
| 10.000.000 EUR | 20.12.2024 | BofA Securities | BAML 12 Names EU Basket | (77.915) | (0,01) |
| 1.000.000 EUR | 19.01.2024 | BNP | BNP 5 Names EU Basket | (24.043) | (0,00) |
| 20.000.000 USD | 17.01.2025 | BNP | BNP 13 Names US Basket | (97.257) | (0,01) |
| 12.500.000 USD | 20.06.2025 | BofA Securities | BAML 19 Names US Basket | (98.585) | (0,01) |
| 20.000.000 USD | 20.12.2024 | UBS | UBS 10 Names US Geo Basket | (105.892) | (0,01) |
| 20.000.000 USD | 17.01.2025 | UBS | UBS 14 Names US Vanilla Basket | (116.406) | (0,01) |
| 10.000.000 EUR | 20.12.2024 | Morgan Stanley | CITI 15 Names US Basket | (142.429) | (0,01) |
| 20.000.000 USD | 20.06.2025 | BNP | BNP 31 Names Global Basket | (149.796) | (0,01) |
| 12.500.000 USD | 17.01.2025 | Morgan Stanley | CITI 24 Names US Basket | (155.036) | (0,01) |
| 15.000.000 USD | 17.01.2025 | BofA Securities | BAML 18 Names US Basket | (179.167) | (0,01) |
| 13.500.000 EUR | 17.01.2025 | BNP | BNP 19 Names Global Basket | (184.865) | (0,01) |
| 20.000.000 USD | 17.01.2025 | Morgan Stanley | CITI 22 Names US Basket | (186.155) | (0,01) |
| 30.000.000 EUR | 20.12.2024 | BNP | BNP 10 Names EU Basket | (196.580) | (0,01) |
| 21.551.100 EUR | 20.12.2024 | Société Générale | SG 15 Names Global Basket | (240.445) | (0,01) |
| 17.500.000 USD | 17.01.2025 | Morgan Stanley | CITI 27 Names US Basket | (247.773) | (0,02) |
| 20.000.000 USD | 17.01.2025 | Morgan Stanley | CITI 20 Names US Basket | (265.585) | (0,02) |
| 20.000.000 USD | 17.01.2025 | Morgan Stanley | CITI 31 Names US Basket | (267.544) | (0,02) |
| 22.500.000 EUR | 17.01.2025 | BNP | BNP 38 Names Global Basket | (291.672) | (0,02) |
| 20.000.000 USD | 17.01.2025 | JPMorgan Chase Bank | JPMorgan Chase Bank 16 Names US Basket | (298.216) | (0,02) |
| 20.000.000 USD | 17.01.2025 | BofA Securities | BAML 27 Names US Basket | (355.578) | (0,02) |

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Volatility-Swap-Kontrakte (0,56 %) (31. Dezember 2022: (0,14 %)) (Fortsetzung)

| Nominalwert | Datum der Schließung | Gegenpartei | Referenzobligation ¹ | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|----------------------|-----------------|---------------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 30.000.000 USD | 17.01.2025 | BofA Securities | BAML 22 Names US Basket | (385.517) | (0,02) |
| 20.000.000 USD | 17.01.2025 | BofA Securities | BAML 19 Names US Basket | (402.675) | (0,02) |
| 40.000.000 USD | 17.01.2025 | UBS | UBS 24 Names US Basket | (419.508) | (0,03) |
| 20.000.000 USD | 17.01.2025 | Morgan Stanley | CITI 22 Names US Basket | (475.225) | (0,03) |
| 50.000.000 USD | 17.01.2025 | Citibank NA | CITI 24 Names US Basket | (479.523) | (0,03) |
| 20.000.000 USD | 17.01.2025 | Morgan Stanley | CITI 26 Names US Basket | (483.775) | (0,03) |
| 50.010.000 USD | 20.06.2025 | Nomura | Nomura 31 Names Global Basket | (508.167) | (0,03) |
| 23.500.000 EUR | 17.01.2025 | BNP | BNP 43 Names EU Basket | (534.662) | (0,03) |
| 30.000.000 USD | 17.01.2025 | Morgan Stanley | CITI 16 Names US Basket | (585.396) | (0,04) |
| 40.000.000 USD | 17.01.2025 | UBS | UBS 29 Names US Basket | (693.114) | (0,05) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Volatility-Swap-Kontrakten[∞] | | | | (8.911.489) | (0,56) |

¹Die Volatilitäten lauten auf verschiedene Fremdwährungen, je nach den Landeswährungen der Positionen in den Swaps.

| | Zeitwert | % des Nettovermögens |
|---|----------------------|----------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (499.958.213) | (30,73) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | 976.303.958 | 60,02 |
| Sonstiges Nettovermögen | 650.397.463 | 39,98 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | 1.626.701.421 | 100,00 |

| Portfolioanalyse | US\$ | % des Gesamtvermögens |
|---|--------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 143.619.130 | 6,29 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 801.699.122 | 35,09 |
| † Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente | 8.000 | 0,00 |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | (15.248.785) | (0,67) |
| ∞ Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate) | 46.226.491 | 2,02 |
| Anlagen insgesamt | 976.303.958 | 42,73 |

US Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|--|---|------------------|------------------------------|
| Aktien 93,23 % (31. Dezember 2022: 85,83 %) | | | |
| US-Dollar | | | |
| 5.596 | AbbVie Inc | 867.212 | 1,76 |
| 1.604 | Adobe Inc | 956.946 | 1,94 |
| 16.859 | Alphabet Inc Class A | 2.355.034 | 4,79 |
| 20.248 | Amazon.com Inc | 3.076.481 | 6,25 |
| 4.246 | Analog Devices Inc | 843.086 | 1,71 |
| 10.145 | Apple Inc | 1.953.217 | 3,97 |
| 1.681 | Atlassian Corp Class A | 399.843 | 0,81 |
| 2.541 | Avery Dennison Corp | 513.688 | 1,04 |
| 10.521 | Boston Scientific Corp | 608.219 | 1,24 |
| 11.301 | Brookfield Asset Management Ltd Class A | 453.961 | 0,92 |
| 3.457 | CDW Corp | 785.845 | 1,60 |
| 23.937 | Chewy Inc Class A | 565.631 | 1,15 |
| 3.304 | CME Group Inc Class A | 695.822 | 1,41 |
| 1.067 | Costco Wholesale Corp | 704.305 | 1,43 |
| 5.342 | Dollar Tree Inc | 758.831 | 1,54 |
| 4.092 | Equifax Inc | 1.011.911 | 2,06 |
| 693 | Home Depot Inc | 240.159 | 0,49 |
| 2.110 | Intuit Inc | 1.318.813 | 2,68 |
| 3.404 | Johnson & Johnson | 533.543 | 1,08 |
| 23.464 | Keurig Dr Pepper Inc | 781.820 | 1,59 |
| 2.809 | Mastercard Inc Class A | 1.198.067 | 2,44 |
| 25.230 | Match Group Inc | 920.895 | 1,87 |
| 3.635 | McDonald's Corp | 1.077.814 | 2,19 |
| 5.631 | Meta Platforms Inc Class A | 1.993.149 | 4,05 |
| 11.573 | Microsoft Corp | 4.351.911 | 8,85 |
| 1.892 | Netflix Inc | 921.177 | 1,87 |
| 14.396 | NextEra Energy Inc | 874.413 | 1,78 |
| 3.287 | NIKE Inc Class B | 356.870 | 0,73 |
| 2.751 | NVIDIA Corp | 1.362.350 | 2,77 |
| 711 | Oddity Tech Ltd Class A | 33.083 | 0,07 |
| 5.849 | Okta Inc Class A | 529.510 | 1,08 |
| 18.811 | Paycor HCM Inc | 406.129 | 0,83 |
| 3.895 | Progressive Corp | 620.396 | 1,26 |
| 1.913 | S&P Global Inc | 842.715 | 1,71 |
| 6.264 | Salesforce Inc | 1.648.309 | 3,35 |
| 1.343 | ServiceNow Inc | 948.816 | 1,93 |
| 14.673 | Sweetgreen Inc Class A | 165.805 | 0,34 |
| 3.996 | TE Connectivity Ltd | 561.438 | 1,14 |
| 1.515 | Thermo Fisher Scientific Inc | 804.147 | 1,63 |

US Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|------------------------|-------------------|----------------------|
| Aktien 93,23 % (31. Dezember 2022: 85,83 %) (Fortsetzung) | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | |
| 11.368 | TJX Cos Inc | 1.066.432 | 2,17 |
| 2.798 | Union Pacific Corp | 687.245 | 1,40 |
| 2.937 | UnitedHealth Group Inc | 1.546.242 | 3,14 |
| 4.434 | Visa Inc Class A | 1.154.392 | 2,35 |
| 3.697 | Walmart Inc | 582.832 | 1,18 |
| 3.906 | Waste Management Inc | 699.565 | 1,42 |
| 3.965 | Workday Inc Class A | 1.094.578 | 2,22 |
| Aktien insgesamt * | | 45.872.647 | 93,23 |
| Anlagen insgesamt | | 45.872.647 | 93,23 |

Devisenterminkontrakte 2,55 % (31. Dezember 2022: 6,86 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|----------------------|-----------|--------------------------------|-----------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen JPY</i> | | | | | | |
| 427.231.585 ¥ | 2.933.786 US\$ | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 11 | 103.962 | 0,21 |
| 3.871.772.129 ¥ | 26.414.867 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 10 | 1.114.639 | 2,27 |
| 148.937.607 ¥ | 1.024.102 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 5 | 34.891 | 0,07 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | 1.253.492 | 2,55 |
| | | | | | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | | | | | 47.126.139 | 95,78 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,24 %) (31. Dezember 2022: (1,74 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|----------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen JPY</i> | | | | | | |
| 25.388.163 ¥ | 180.587 US\$ | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 1 | (69) | (0,00) |
| 1.028.930 US\$ | 149.667.542 ¥ | 18.01.2024 | Royal Bank of Canada | 4 | (35.254) | (0,07) |
| 1.069.165 US\$ | 156.974.027 ¥ | 18.01.2024 | UBS AG | 3 | (46.969) | (0,10) |
| 720.916 US\$ | 106.547.535 ¥ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 4 | (36.671) | (0,07) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | (118.963) | (0,24) |

US Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|---|-------------------|---------------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (118.963) | (0,24) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | 47.007.176 | 95,54 |
| Sonstiges Nettovermögen | 2.194.973 | 4,46 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | 49.202.149 | 100,00 |

| Portfolioanalyse | US\$ | % des Gesamtver- mögens |
|---|-------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 45.872.647 | 92,21 |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente | 1.134.529 | 2,28 |
| Anlagen insgesamt | 47.007.176 | 94,49 |

US Equity Index PutWrite - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital- betrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeits- datum | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|--|----------------------------------|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| Staatsanleihen 90,98 % (31. Dezember 2022: 92,92 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 86.400.000 | United States Treasury Note/Bond | 0,25 % | 15.03.2024 | 85.540.224 | 11,73 |
| 90.000.000 | United States Treasury Note/Bond | 0,25 % | 15.06.2024 | 88.036.705 | 12,07 |
| 90.000.000 | United States Treasury Note/Bond | 0,38 % | 15.09.2024 | 87.162.353 | 11,96 |
| 87.100.000 | United States Treasury Note/Bond | 1,00 % | 15.12.2024 | 83.997.550 | 11,52 |
| 80.700.000 | United States Treasury Note/Bond | 1,75 % | 15.03.2025 | 77.988.985 | 10,70 |
| 82.300.000 | United States Treasury Note/Bond | 2,88 % | 15.06.2025 | 80.446.643 | 11,03 |
| 82.300.000 | United States Treasury Note/Bond | 3,50 % | 15.09.2025 | 81.099.256 | 11,12 |
| 79.500.000 | United States Treasury Note/Bond | 4,00 % | 15.12.2025 | 79.085.420 | 10,85 |
| Staatsanleihen insgesamt * | | | | 663.357.136 | 90,98 |
| Anlagen insgesamt | | | | 663.357.136 | 90,98 |

Devisenterminkontrakte 1,67 % (31. Dezember 2022: 2,44 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeits- datum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|------------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------------|---------------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 235.935 € | 253.199 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | 7.589 | 0,00 |
| 10.876.779 € | 11.621.373 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 32 | 401.136 | 0,06 |
| 67.171 US\$ | 60.448 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 355 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 2.066.375 £ | 2.553.703 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 80.743 | 0,01 |
| 249.724.445 £ | 306.742.430 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 64 | 11.634.206 | 1,60 |
| 315.939 US\$ | 247.436 £ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 4 | 479 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i> | | | | | | |
| 179.581 SGD | 132.180 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 8 | 4.058 | 0,00 |
| 16.043 SGD | 11.933 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 12 | 239 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | 12.128.805 | 1,67 |
| | | | | | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | | | | | 675.485.941 | 92,65 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,07 %) (31. Dezember 2022: (0,20 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeits- datum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettover- mögens |
|---------------------------------|------------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------|--|------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 102.217 € | 113.360 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | (376) | (0,00) |
| 240.403 US\$ | 226.022 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | (9.428) | (0,00) |
| 995.101 US\$ | 923.316 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 53 | (25.475) | (0,00) |

US Equity Index PutWrite - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (0,07 %) (31. Dezember 2022: (0,20 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 2.066.220 € | 2.642.933 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (8.685) | (0,00) |
| 2.631.658 € | 3.358.922 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | (3.790) | (0,00) |
| 5.311.781 US\$ | 4.370.234 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (259.882) | (0,04) |
| 9.365.948 US\$ | 7.527.011 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 50 | (230.328) | (0,03) |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i> | | | | | | |
| 6.587 SGD | 4.997 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | (0) | (0,00) |
| 3.866 US\$ | 5.281 SGD | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | (140) | (0,00) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ** | | | | | (538.104) | (0,07) |

Verkaufte Optionskontrakte (0,72 %) (31. Dezember 2022: (1,90 %))

| Anzahl Kontrakte | Fälligkeit | Art | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------------------|------------|---|---------------|----------------------|
| Verkaufsoptionen | | | | |
| (2) | 05.01.2024 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,605.00 | (140) | (0,00) |
| (71) | 12.01.2024 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,635.00 | (38.340) | (0,00) |
| (69) | 12.01.2024 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,645.00 | (42.090) | (0,01) |
| (85) | 12.01.2024 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,710.00 | (121.975) | (0,02) |
| (56) | 12.01.2024 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,725.00 | (98.560) | (0,01) |
| (23) | 12.01.2024 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,740.00 | (49.795) | (0,01) |
| (3) | 05.01.2024 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,760.00 | (5.130) | (0,00) |
| (183) | 05.01.2024 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,770.00 | (393.450) | (0,05) |
| (46) | 05.01.2024 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,780.00 | (119.370) | (0,02) |
| (16) | 26.01.2024 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,780.00 | (79.280) | (0,01) |
| (26) | 05.01.2024 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,785.00 | (75.140) | (0,01) |
| (332) | 26.01.2024 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,785.00 | (1.724.740) | (0,24) |
| (11) | 02.02.2024 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,785.00 | (67.430) | (0,01) |
| (91) | 05.01.2024 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,790.00 | (285.285) | (0,04) |
| (12) | 05.01.2024 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,795.00 | (41.160) | (0,01) |
| (7) | 12.01.2024 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,795.00 | (30.800) | (0,00) |
| (15) | 26.01.2024 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,795.00 | (84.300) | (0,01) |
| (6) | 05.01.2024 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,800.00 | (23.700) | (0,00) |
| (69) | 12.01.2024 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,800.00 | (334.650) | (0,05) |
| (13) | 26.01.2024 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,800.00 | (78.390) | (0,01) |
| (4) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,735.00 | (10.440) | (0,00) |
| (23) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,740.00 | (63.480) | (0,01) |
| (40) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,760.00 | (137.600) | (0,02) |
| (21) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,770.00 | (79.590) | (0,01) |
| (176) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,780.00 | (744.480) | (0,10) |

US Equity Index PutWrite - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte (0,72 %) (31. Dezember 2022: (1,90 %)) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte | Fälligkeit | Art | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|---|------------|--|----------------------|-----------------------------|
| Verkaufsoptionen (Fortsetzung) | | | | |
| (112) | 19.01.2024 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,790.00 | (522.480) | (0,07) |
| Beizulegender Zeitwert aus verkauften Optionskontrakten insgesamt * (Prämie: 7.471.523 US\$) | | | (5.251.795) | (0,72) |
| | | | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | | | (5.789.899) | (0,79) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | | | 669.696.042 | 91,86 |
| Sonstiges Nettovermögen | | | 59.401.958 | 8,14 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | | | 729.098.000 | 100,00 |

| Portfolioanalyse | | US\$ | % des Gesamtvermögens |
|--------------------------|---|--------------------|-----------------------|
| * | Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 663.357.136 | 90,05 |
| ± | Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | (5.251.795) | (0,71) |
| ∞ | OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente | 11.590.701 | 1,57 |
| Anlagen insgesamt | | 669.696.042 | 90,91 |

US Large Cap Value - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|--|--------------------------------------|------------------|------------------------------|
| Aktien 95,28 % (31. Dezember 2022: 95,51 %) | | | |
| US-Dollar | | | |
| 117.656 | 3M Co | 12.862.154 | 0,66 |
| 345.761 | Agnico Eagle Mines Ltd | 18.964.991 | 0,98 |
| 72.115 | Air Products & Chemicals Inc | 19.745.087 | 1,02 |
| 469.680 | American Electric Power Co Inc | 38.147.410 | 1,97 |
| 57.874 | American International Group Inc | 3.920.963 | 0,20 |
| 63.757 | Amgen Inc | 18.363.291 | 0,95 |
| 76.980 | Applied Materials Inc | 12.476.149 | 0,64 |
| 1.104.636 | AT&T Inc | 18.535.792 | 0,96 |
| 626.489 | Bank of America Corp | 21.093.885 | 1,09 |
| 159.125 | Becton Dickinson & Co | 38.799.449 | 2,00 |
| 139.714 | Berkshire Hathaway Inc Class B | 49.830.395 | 2,57 |
| 258.289 | Bristol-Myers Squibb Co | 13.252.809 | 0,68 |
| 21.063 | CBRE Group Inc Class A | 1.960.755 | 0,10 |
| 833.666 | CenterPoint Energy Inc | 23.817.838 | 1,23 |
| 560.152 | Citigroup Inc | 28.814.219 | 1,49 |
| 126.520 | CME Group Inc Class A | 26.645.112 | 1,37 |
| 206.541 | Colgate-Palmolive Co | 16.463.383 | 0,85 |
| 420.672 | Comcast Corp Class A | 18.446.467 | 0,95 |
| 68.938 | ConocoPhillips | 8.001.634 | 0,41 |
| 54.805 | Constellation Brands Inc Class A | 13.249.109 | 0,68 |
| 278.278 | CVS Health Corp | 21.972.831 | 1,13 |
| 98.533 | Danaher Corp | 22.794.624 | 1,18 |
| 135.701 | Devon Energy Corp | 6.147.255 | 0,32 |
| 224.901 | Dominion Energy Inc | 10.570.347 | 0,54 |
| 552.679 | DTE Energy Co | 60.938.386 | 3,14 |
| 766.589 | Duke Energy Corp | 74.389.796 | 3,84 |
| 30.708 | Elevance Health Inc | 14.480.664 | 0,75 |
| 1.482.951 | Exelon Corp | 53.237.941 | 2,74 |
| 533.271 | Exxon Mobil Corp | 53.316.435 | 2,75 |
| 5.448 | Fastenal Co | 352.867 | 0,02 |
| 156.435 | FirstEnergy Corp | 5.734.907 | 0,30 |
| 162.876 | Franco-Nevada Corp | 18.048.289 | 0,93 |
| 665.557 | Freeport-McMoRan Inc | 28.332.761 | 1,46 |
| 578.307 | Gilead Sciences Inc | 46.848.650 | 2,42 |
| 30.811 | Intercontinental Exchange Inc | 3.957.057 | 0,20 |
| 139.497 | International Business Machines Corp | 22.814.734 | 1,18 |
| 456.631 | Johnson & Johnson | 71.572.343 | 3,69 |

US Large Cap Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|-------------------------------------|----------------------|----------------------|
| Aktien 95,28 % (31. Dezember 2022: 95,51 %) (Fortsetzung) | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | |
| 313.669 | JPMorgan Chase & Co | 53.355.097 | 2,75 |
| 329.383 | Kenvue Inc | 7.091.616 | 0,37 |
| 641.260 | Kroger Co | 29.311.995 | 1,51 |
| 461.370 | Las Vegas Sands Corp | 22.704.018 | 1,17 |
| 25.729 | Lockheed Martin Corp | 11.661.412 | 0,60 |
| 574.710 | Merck & Co Inc | 62.654.884 | 3,23 |
| 815.400 | Mondelez International Inc Class A | 59.059.422 | 3,05 |
| 118.812 | Mosaic Co | 4.245.153 | 0,22 |
| 1.022.356 | Newmont Corp | 42.315.315 | 2,18 |
| 59.175 | NIKE Inc Class B | 6.424.630 | 0,33 |
| 34.248 | Nucor Corp | 5.960.522 | 0,31 |
| 1.825.832 | Pfizer Inc | 52.565.703 | 2,71 |
| 237.949 | Philip Morris International Inc | 22.386.242 | 1,15 |
| 338.196 | PNC Financial Services Group Inc | 52.369.651 | 2,70 |
| 544.896 | Procter & Gamble Co | 79.849.060 | 4,12 |
| 333.271 | Public Service Enterprise Group Inc | 20.379.522 | 1,05 |
| 13.297 | QUALCOMM Inc | 1.923.145 | 0,10 |
| 665.997 | Rio Tinto Plc ADR | 49.590.137 | 2,56 |
| 7.471 | S&P Global Inc | 3.291.125 | 0,17 |
| 825.476 | Sempra | 61.687.821 | 3,18 |
| 15.516 | Sherwin-Williams Co | 4.839.440 | 0,25 |
| 213.620 | Southern Copper Corp | 18.386.273 | 0,95 |
| 98.172 | Stryker Corp | 29.398.587 | 1,52 |
| 42.980 | T-Mobile US Inc | 6.890.983 | 0,35 |
| 356.245 | Truist Financial Corp | 13.152.565 | 0,68 |
| 57.912 | UnitedHealth Group Inc | 30.488.931 | 1,57 |
| 760.909 | Verizon Communications Inc | 28.686.269 | 1,48 |
| 333.823 | Walmart Inc | 52.627.196 | 2,71 |
| 66.000 | Waste Management Inc | 11.820.600 | 0,61 |
| 363.710 | Wells Fargo & Co | 17.901.806 | 0,92 |
| 542.532 | Wheaton Precious Metals Corp | 26.768.529 | 1,38 |
| 411.084 | Williams Cos Inc | 14.318.056 | 0,74 |
| 202.702 | Zimmer Biomet Holdings Inc | 24.668.833 | 1,27 |
| Aktien insgesamt * | | 1.847.675.317 | 95,28 |

US Large Cap Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|-----------------------|----------------------|----------------------|
| Immobilienaktiengesellschaften 0,20 % (31. Dezember 2022: 0,00 %) | | | |
| US-Dollar | | | |
| 4.844 | Equinix Inc | 3.901.309 | 0,20 |
| Immobilienaktiengesellschaften insgesamt * | | 3.901.309 | 0,20 |
| Anlagen insgesamt | | 1.851.576.626 | 95,48 |

Devisenterminkontrakte 0,06 % (31. Dezember 2022: 0,06 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-------------------------|-----------|--------------------------------|-----------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 26.290.661 € | 28.035.510 US\$ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 8 | 1.024.546 | 0,05 |
| 3.536.840 € | 3.832.644 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 40 | 76.760 | 0,01 |
| 41.155 US\$ | 37.030 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 5 | 223 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 179.876 £ | 221.123 US\$ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 6 | 8.203 | 0,00 |
| 205.760 £ | 253.047 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 14 | 9.280 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | 1.119.012 | 0,06 |
| | | | | | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | | | | | 1.852.695.638 | 95,54 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,01 %) (31. Dezember 2022: (0,01 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 220.591 € | 244.392 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (564) | (0,00) |
| 1.574.949 US\$ | 1.456.862 € | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 7 | (35.374) | (0,00) |
| 2.491.567 US\$ | 2.324.866 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 79 | (78.190) | (0,01) |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 7.164 £ | 9.164 US\$ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 1 | (30) | (0,00) |
| 15.573 US\$ | 12.598 £ | 18.01.2024 | Standard Chartered Bank | 5 | (489) | (0,00) |
| 35.085 US\$ | 28.445 £ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 8 | (1.180) | (0,00) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | (115.827) | (0,01) |

US Large Cap Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|----------------------|------------------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (115.827) | (0,01) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | 1.852.579.811 | 95,53 |
| Sonstiges Nettovermögen | 86.610.567 | 4,47 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | 1.939.190.378 | 100,00 |

| Portfolioanalyse | US\$ | % des Gesamtver- mögens |
|---|----------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 1.851.576.626 | 91,92 |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente | 1.003.185 | 0,05 |
| Anlagen insgesamt | 1.852.579.811 | 91,97 |

US Long Short Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|--|-----------------------------------|------------------|------------------------------|
| Aktien 85,22 % (31. Dezember 2022: 71,33 %) | | | |
| Euro | | | |
| 10.679 | Airbus SE* | 1.648.923 | 0,84 |
| Euro insgesamt | | 1.648.923 | 0,84 |
| US-Dollar | | | |
| 7.805 | AbbVie Inc* | 1.209.541 | 0,62 |
| 6.270 | Adobe Inc* | 3.740.682 | 1,91 |
| 38.327 | Alphabet Inc Class A* | 5.353.899 | 2,74 |
| 43.026 | Amazon.com Inc* | 6.537.370 | 3,34 |
| 13.817 | Amphenol Corp Class A* | 1.369.679 | 0,70 |
| 9.216 | Analog Devices Inc* | 1.829.929 | 0,94 |
| 25.712 | Apple Inc* | 4.950.331 | 2,53 |
| 7.577 | Asbury Automotive Group Inc* | 1.704.598 | 0,87 |
| 10.985 | Ashland Inc* | 926.145 | 0,47 |
| 1.461 | ASML Holding NV* | 1.105.860 | 0,57 |
| 3.716 | Atlassian Corp Class A* | 883.888 | 0,45 |
| 9.639 | Avery Dennison Corp* | 1.948.620 | 1,00 |
| 5.418 | Boeing Co* | 1.412.256 | 0,72 |
| 32.374 | Boston Scientific Corp* | 1.871.541 | 0,96 |
| 43.258 | Brookfield Corp* | 1.735.511 | 0,89 |
| 6.972 | CDW Corp* | 1.584.875 | 0,81 |
| 102.578 | Celebration Bidco Holdings LLC** | 1.538.670 | 0,79 |
| 89.489 | CenterPoint Energy Inc* | 2.556.701 | 1,31 |
| 21.432 | Chevron Corp* | 3.196.797 | 1,64 |
| 94.471 | Chewy Inc Class A* | 2.232.350 | 1,14 |
| 13.284 | CME Group Inc Class A* | 2.797.610 | 1,43 |
| 1.759 | Costco Wholesale Corp* | 1.161.081 | 0,59 |
| 23.073 | Dollar Tree Inc* | 3.277.520 | 1,68 |
| 12.228 | Equifax Inc* | 3.023.862 | 1,55 |
| 35.393 | European Wax Center Inc Class A* | 480.991 | 0,25 |
| 17.684 | First Watch Restaurant Group Inc* | 355.448 | 0,18 |
| 44.424 | FirstEnergy Corp* | 1.628.584 | 0,83 |
| 3.614 | Home Depot Inc* | 1.252.432 | 0,64 |
| 1.731 | Humana Inc* | 792.469 | 0,41 |
| 3.487 | Illumina Inc* | 485.530 | 0,25 |
| 3.748 | Intuit Inc* | 2.342.612 | 1,20 |
| 14.415 | Jacobs Solutions Inc* | 1.871.067 | 0,96 |
| 8.642 | Johnson & Johnson* | 1.354.547 | 0,69 |
| 18.700 | JPMorgan Chase & Co* | 3.180.870 | 1,63 |
| 50.887 | Kenvue Inc* | 1.095.597 | 0,56 |
| 120.344 | Keurig Dr Pepper Inc* | 4.009.862 | 2,05 |

US Long Short Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|-------------------------------------|--------------------|----------------------|
| Aktien 85,22 % (31. Dezember 2022: 71,33 %) (Fortsetzung) | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | |
| 1.428 | Klaviyo Inc Class A* | 39.670 | 0,02 |
| 2.500 | L3Harris Technologies Inc* | 526.550 | 0,27 |
| 5.977 | Lamb Weston Holdings Inc* | 646.054 | 0,33 |
| 3.169 | Marriott International Inc Class A* | 714.641 | 0,37 |
| 7.078 | Mastercard Inc Class A* | 3.018.838 | 1,54 |
| 84.663 | Match Group Inc* | 3.090.199 | 1,58 |
| 16.879 | McDonald's Corp* | 5.004.792 | 2,56 |
| 14.429 | Meta Platforms Inc Class A* | 5.107.289 | 2,61 |
| 23.061 | Microsoft Corp* | 8.671.858 | 4,44 |
| 20.459 | Mondelez International Inc Class A* | 1.481.845 | 0,76 |
| 4.283 | Netflix Inc* | 2.085.307 | 1,07 |
| 58.002 | NextEra Energy Inc* | 3.523.041 | 1,80 |
| 8.300 | NIKE Inc Class B* | 901.131 | 0,46 |
| 30.687 | nVent Electric Plc* | 1.813.295 | 0,93 |
| 3.139 | NVIDIA Corp* | 1.554.496 | 0,80 |
| 5.738 | Oddity Tech Ltd Class A* | 266.989 | 0,14 |
| 18.680 | Okta Inc Class A* | 1.691.100 | 0,87 |
| 70.264 | Paramount Global Class B* | 1.039.205 | 0,53 |
| 77.520 | Paycor HCM Inc* | 1.673.657 | 0,86 |
| 6.788 | Procter & Gamble Co* | 994.714 | 0,51 |
| 15.646 | Progressive Corp* | 2.492.095 | 1,27 |
| 89.080 | Repay Holdings Corp Class A* | 760.743 | 0,39 |
| 6.719 | S&P Global Inc* | 2.959.854 | 1,51 |
| 19.930 | Salesforce Inc* | 5.244.380 | 2,68 |
| 2.831 | ServiceNow Inc* | 2.000.073 | 1,02 |
| 10.742 | Splunk Inc* | 1.636.544 | 0,84 |
| 73.046 | Sweetgreen Inc Class A* | 825.420 | 0,42 |
| 8.405 | TE Connectivity Ltd* | 1.180.902 | 0,60 |
| 3.405 | Thermo Fisher Scientific Inc* | 1.807.340 | 0,92 |
| 45.502 | TJX Cos Inc* | 4.268.543 | 2,18 |
| 17.047 | Uber Technologies Inc* | 1.049.584 | 0,54 |
| 16.479 | Union Pacific Corp* | 4.047.572 | 2,07 |
| 7.063 | UnitedHealth Group Inc* | 3.718.458 | 1,90 |
| 11.437 | Visa Inc Class A* | 2.977.623 | 1,52 |
| 11.987 | Walmart Inc* | 1.889.751 | 0,97 |
| 11.997 | Waste Management Inc* | 2.148.663 | 1,10 |
| 33.165 | WEC Energy Group Inc* | 2.791.498 | 1,43 |
| 9.025 | Workday Inc Class A* | 2.491.441 | 1,27 |
| | US-Dollar insgesamt | 164.934.480 | 84,38 |
| | Aktien insgesamt | 166.583.403 | 85,22 |

US Long Short Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | | | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|--|---------|------------------|--------------------|----------------------|
| Immobilienaktiengesellschaften 1,81 % (31. Dezember 2022: 0,79 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 2.104 | Equinix Inc | | | 1.694.541 | 0,87 |
| 7.251 | SBA Communications Corp Class A | | | 1.839.506 | 0,94 |
| Immobilienaktiengesellschaften insgesamt * | | | | 3.534.047 | 1,81 |
| Kapitalbetrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeitsdatum | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
| Unternehmensanleihen 3,92 % (31. Dezember 2022: 3,79 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 404.000 | Alphabet Inc** | 2,25 % | 15.08.2060 | 250.278 | 0,13 |
| 690.000 | Amazon.com Inc** | 3,25 % | 12.05.2061 | 506.934 | 0,26 |
| 1.095.119 | Anagram Holdings LLC/Anagram International Inc** | 10,00 % | 15.08.2026 | 0 | 0,00 |
| 819.000 | Apple Inc** | 2,85 % | 05.08.2061 | 560.472 | 0,29 |
| 250.000 | CDW LLC/CDW Finance Corp** | 2,67 % | 01.12.2026 | 234.135 | 0,12 |
| 550.000 | Florida Power & Light Co* | 2,88 % | 04.12.2051 | 381.948 | 0,20 |
| 943.000 | Johnson & Johnson* | 2,45 % | 01.09.2060 | 606.631 | 0,31 |
| 138.000 | Mastercard Inc* | 2,95 % | 15.03.2051 | 102.499 | 0,05 |
| 954.000 | Meta Platforms Inc** | 4,65 % | 15.08.2062 | 889.197 | 0,45 |
| 253.000 | Meta Platforms Inc** | 5,60 % | 15.05.2053 | 274.413 | 0,14 |
| 18.000 | Meta Platforms Inc** | 5,75 % | 15.05.2063 | 19.728 | 0,01 |
| 939.000 | Microsoft Corp** | 2,50 % | 15.09.2050 | 634.977 | 0,32 |
| 520.000 | Microsoft Corp** | 2,68 % | 01.06.2060 | 347.634 | 0,18 |
| 125.000 | nVent Finance Sarl** | 4,55 % | 15.04.2028 | 121.544 | 0,06 |
| 455.000 | Oracle Corp* | 3,85 % | 01.04.2060 | 330.361 | 0,17 |
| 45.000 | Oracle Corp* | 6,90 % | 09.11.2052 | 52.868 | 0,03 |
| 545.000 | PepsiCo Inc** | 2,75 % | 21.10.2051 | 387.717 | 0,20 |
| 125.000 | SBA Communications Corp** | 3,88 % | 15.02.2027 | 120.125 | 0,06 |
| 410.000 | Uber Technologies Inc** | 8,00 % | 01.11.2026 | 417.891 | 0,21 |
| 564.000 | UnitedHealth Group Inc* | 3,13 % | 15.05.2060 | 401.197 | 0,20 |
| 185.000 | UnitedHealth Group Inc* | 5,05 % | 15.04.2053 | 187.060 | 0,10 |
| 943.000 | Walmart Inc* | 2,65 % | 22.09.2051 | 658.095 | 0,34 |
| 190.000 | Walmart Inc* | 4,50 % | 15.04.2053 | 184.831 | 0,09 |
| Unternehmensanleihen insgesamt | | | | 7.670.535 | 3,92 |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen 0,25 % (31. Dezember 2022: 0,00 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 487.831 | Celebration Bidco LLC | 15,50 % | 29.12.2028 | 487.831 | 0,25 |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen insgesamt † | | | | 487.831 | 0,25 |
| Anlagen insgesamt | | | | 178.275.816 | 91,20 |

US Long Short Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 1,68 % (31. Dezember 2022: 3,02 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 1.409.287 € | 1.525.145 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | 32.593 | 0,02 |
| 41.429.286 € | 44.171.958 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 8 | 1.621.390 | 0,83 |
| 38.857.624 € | 41.389.210 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 26 | 1.561.584 | 0,80 |
| 187.347 US\$ | 168.576 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 4 | 1.013 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 20.304 £ | 25.015 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | 871 | 0,00 |
| 6.979 £ | 8.582 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | 316 | 0,00 |
| 1.543.817 £ | 1.909.718 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 13 | 58.513 | 0,03 |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i> | | | | | | |
| 312.630 SGD | 230.089 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | 7.087 | 0,00 |
| 1.188 SGD | 887 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | 14 | 0,00 |
| 17.726 SGD | 13.126 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 13 | 323 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten [~] | | | | | 3.283.704 | 1,68 |

Differenzkontrakte 0,32 % (31. Dezember 2022: 1,43 %)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---------|------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 315.480 | Adyen NV | JPMorgan Chase Bank | 8.574 | 0,01 |
| 201.218 | Agilon Health Inc | Goldman Sachs International | 56.127 | 0,03 |
| 391.490 | BJ's Wholesale Club Holdings Inc | Goldman Sachs International | 14.339 | 0,01 |
| 257.548 | Campbell Soup Co | Goldman Sachs International | 53.873 | 0,03 |
| 945.318 | CarMax Inc | Goldman Sachs International | 77.413 | 0,04 |
| 179.017 | Conagra Brands Inc | JPMorgan Chase Bank | 4.234 | 0,00 |
| 344.323 | Conagra Brands Inc | Goldman Sachs International | 41.750 | 0,02 |
| 100.638 | Estee Lauder Companies Class A | Goldman Sachs International | 2.014 | 0,00 |
| 278.313 | Exelon Corp | Goldman Sachs International | 2.150 | 0,00 |
| 80.679 | Figs Inc Class A | Goldman Sachs International | 8 | 0,00 |
| 89.115 | Floor & Decor Holdings Inc Class A | JPMorgan Chase Bank | 225 | 0,00 |
| 27.560 | Fubotv Inc | JPMorgan Chase Bank | 2.102 | 0,00 |
| 334.155 | Grocery Outlet Holding Corp | Goldman Sachs International | 45.325 | 0,02 |
| 17.294 | Grocery Outlet Holding Corp | JPMorgan Chase Bank | 1.069 | 0,00 |
| 561.080 | Interpublic Group of Cos Inc | Goldman Sachs International | 72.970 | 0,04 |
| 212.917 | Joby Aviation Inc | JPMorgan Chase Bank | 7.980 | 0,01 |
| 622.509 | Lamar Advertising Co Class A | JPMorgan Chase Bank | 6.726 | 0,00 |
| 103.859 | Lemonade Inc | Goldman Sachs International | 5.423 | 0,00 |
| 263.979 | Maplebear Inc | Citibank NA | 59.547 | 0,03 |
| 500.873 | Paycom Software Inc | Goldman Sachs International | 84.907 | 0,04 |
| 100.717 | Renaissancere Holdings Ltd | Goldman Sachs International | 11.797 | 0,01 |
| 224.962 | Renaissancere Holdings Ltd | JPMorgan Chase Bank | 127 | 0,00 |
| 336.990 | Southern Co | Goldman Sachs International | 1.205 | 0,00 |

US Long Short Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 0,32 % (31. Dezember 2022: 1,43 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------------|-----------------------------|--------------------------------|-----------------------------|
| 351.256 | Southern Co | JPMorgan Chase Bank | 3.721 | 0,00 |
| 369.155 | Tesla Inc | JPMorgan Chase Bank | 7.339 | 0,00 |
| 174.233 | Trade Desk Inc Class A | JPMorgan Chase Bank | 6.909 | 0,00 |
| 102.012 | Vita Coco Co Inc | JPMorgan Chase Bank | 1.909 | 0,00 |
| 638.340 | Warner Bros Discovery Inc | Goldman Sachs International | 34.650 | 0,02 |
| 221.668 | World Acceptance Corp | JPMorgan Chase Bank | 10.016 | 0,01 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Differenzkontrakten [∞] | | | 624.429 | 0,32 |
| | | | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | | | 182.183.949 | 93,20 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,18 %) (31. Dezember 2022: (0,37 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 368.698 € | 407.986 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (450) | (0,00) |
| 2.159.888 US\$ | 2.026.523 € | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (80.104) | (0,04) |
| 9.791.741 US\$ | 9.092.564 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 88 | (258.616) | (0,14) |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> | | | | | | |
| 8.323 £ | 10.613 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (2) | (0,00) |
| 10.278 US\$ | 8.098 £ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (46) | (0,00) |
| 8.024 US\$ | 6.622 £ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (419) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i> | | | | | | |
| 890 SGD | 675 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (0) | (0,00) |
| 92.726 US\$ | 125.996 SGD | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | (2.861) | (0,00) |
| 740 US\$ | 985 SGD | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (7) | (0,00) |
| 22.000 US\$ | 29.481 SGD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 12 | (365) | (0,00) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | (342.870) | (0,18) |

Futures-Kontrakte (0,51 %) (31. Dezember 2022: (0,00 %))

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|-------------------------------------|---------------------------------|----------------------|
| (24) | Nasdaq 100 E-mini Future March 2024 | (276.423) | (0,14) |
| (102) | S&P 500 E-mini Future March 2024 | (727.005) | (0,37) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten [‡] | | (1.003.428) | (0,51) |

US Long Short Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte (0,01 %) (31. Dezember 2022: (0,03 %))

| Anzahl Kontrakte | Fällig-keit | Art | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|-------------|---------------------------------|-----------------|----------------------|
| Verkaufsoptionen | | | | |
| (194) | 19.07.2024 | Chewy Inc, Strike Price \$15.00 | (15.714) | (0,01) |
| Beizulegender Zeitwert aus verkauften Optionskontrakten insgesamt * (Prämie: 17.165 US\$) | | | (15.714) | (0,01) |

Differenzkontrakte (1,40 %) (31. Dezember 2022: (0,58 %))

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------|--|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 159.813 | Agilent Technologies Inc | JPMorgan Chase Bank | (2.648) | (0,00) |
| 111.698 | Arm Holdings Plc | JPMorgan Chase Bank | (6.563) | (0,00) |
| 198.845 | Arm Holdings Plc | Goldman Sachs International | (84.982) | (0,04) |
| 563.898 | Best Buy Co Inc | Goldman Sachs International | (30.927) | (0,02) |
| 120.746 | Birkenstock Holding Plc | Citibank NA | (41.584) | (0,02) |
| 79.723 | BJ's Wholesale Club Holdings Inc | JPMorgan Chase Bank | (1.170) | (0,00) |
| 86.748 | Cava Group Inc | Goldman Sachs International | (22.316) | (0,01) |
| 94.516 | Cava Group Inc | JPMorgan Chase Bank | (7.118) | (0,00) |
| 346.896 | Centene Corp | Goldman Sachs International | (39.579) | (0,02) |
| 118.718 | Clearway Energy Inc Class C | JPMorgan Chase Bank | (3.706) | (0,00) |
| 108.544 | Clearway Energy Inc Class C | Goldman Sachs International | (34.680) | (0,02) |
| 503.325 | Credit Acceptance Corp | Goldman Sachs International | (121.458) | (0,06) |
| 308.123 | Darden Restaurants Inc | JPMorgan Chase Bank | (3.453) | (0,00) |
| 237.741 | Darden Restaurants Inc | Goldman Sachs International | (36.113) | (0,02) |
| 264.106 | Davita Healthcare Partner Inc | Goldman Sachs International | (85.980) | (0,04) |
| 263.635 | Dollar General Corp | JPMorgan Chase Bank | (12.203) | (0,01) |
| 713.873 | Dollar General Corp | Goldman Sachs International | (61.685) | (0,03) |
| 489.369 | Eaton Corp Plc | JPMorgan Chase Bank | (7.059) | (0,00) |
| 197.614 | Etsy Inc | Goldman Sachs International | (23.084) | (0,01) |
| 300.601 | Expeditors International of Washington Inc | JPMorgan Chase Bank | (6.696) | (0,00) |
| 806.258 | Floor & Decor Holdings Inc Class A | Goldman Sachs International | (146.879) | (0,08) |
| 67.474 | Flowers Foods Inc | Goldman Sachs International | (7.380) | (0,00) |
| 104.544 | Fubotv Inc | Goldman Sachs International | (58.101) | (0,03) |
| 215.548 | Graco Inc | JPMorgan Chase Bank | (4.255) | (0,00) |
| 603.484 | HubSpot Inc | JPMorgan Chase Bank | (24.737) | (0,01) |
| 401.352 | Illinois Tool Works Inc | Goldman Sachs International | (47.204) | (0,02) |
| 297.228 | Illinois Tool Works Inc | JPMorgan Chase Bank | (4.158) | (0,00) |
| 141.971 | Ingersoll Rand Inc | Goldman Sachs International | (104.302) | (0,05) |
| 341.445 | International Business Machines Corp | Goldman Sachs International | (34.696) | (0,02) |
| 61.728 | Iron Mountain Inc | Goldman Sachs International | (36.638) | (0,02) |
| 348.452 | Iron Mountain Inc | JPMorgan Chase Bank | (10.726) | (0,01) |
| 256.469 | ITT Inc | Goldman Sachs International | (58.499) | (0,03) |
| 97.427 | J & J Snack Foods Corp | Goldman Sachs International | (9.401) | (0,01) |

US Long Short Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,40 %) (31. Dezember 2022: (0,58 %)) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|-----------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 255.232 | JM Smucker Co | JPMorgan Chase Bank | (5.809) | (0,00) |
| 450.200 | JM Smucker Co | Goldman Sachs International | (24.614) | (0,01) |
| 189.443 | Kroger Co | Goldman Sachs International | (9.069) | (0,01) |
| 525.248 | Lamar Advertising Co Class A | Goldman Sachs International | (8.312) | (0,01) |
| 215.939 | Landstar System Inc | Goldman Sachs International | (14.663) | (0,01) |
| 32.281 | McCormick & Co Inc | JPMorgan Chase Bank | (755) | (0,00) |
| 246.046 | McCormick & Co Inc | Goldman Sachs International | (10.622) | (0,01) |
| 116.057 | Mettler-Toledo International | Goldman Sachs International | (29.379) | (0,02) |
| 352.669 | Moelis & Co Class A | Goldman Sachs International | (113.510) | (0,06) |
| 579.334 | Omnicom Group Inc | Goldman Sachs International | (25.905) | (0,01) |
| 241.826 | Opendoor Technologies Inc | JPMorgan Chase Bank | (33.192) | (0,02) |
| 42.092 | Opendoor Technologies Inc | Goldman Sachs International | (45.503) | (0,02) |
| 735.157 | Palantir Technologies Inc Class A | Goldman Sachs International | (169.522) | (0,09) |
| 25.221 | Paycom Software Inc | JPMorgan Chase Bank | (494) | (0,00) |
| 211.959 | Redfin Corp | Goldman Sachs International | (80.707) | (0,04) |
| 47.128 | Redfin Corp | JPMorgan Chase Bank | (4.486) | (0,00) |
| 49.456 | Robert Half Inc | JPMorgan Chase Bank | (523) | (0,00) |
| 284.924 | Robert Half Inc | Goldman Sachs International | (44.764) | (0,02) |
| 367.119 | ROBLOX Corp Class A | Goldman Sachs International | (67.783) | (0,04) |
| 536.114 | Ryan Specialty Holdings Inc | JPMorgan Chase Bank | (10.272) | (0,01) |
| 488.591 | Samsara Inc Class A | Goldman Sachs International | (189.965) | (0,10) |
| 456.684 | SAP SE | Goldman Sachs International | (65.829) | (0,03) |
| 387.094 | Shutterstock Inc | Goldman Sachs International | (20.365) | (0,01) |
| 310.241 | Sonic Automotive Inc Class A | JPMorgan Chase Bank | (9.259) | (0,01) |
| 418.239 | Sonic Automotive Inc Class A | Goldman Sachs International | (49.169) | (0,03) |
| 158.382 | Sprouts Farmers Market Inc | Goldman Sachs International | (51.682) | (0,03) |
| 208.086 | Steelcase Inc Class A | JPMorgan Chase Bank | (18.851) | (0,01) |
| 99.389 | Steelcase Inc Class A | Goldman Sachs International | (13.529) | (0,01) |
| 114.505 | Sunrun Inc | Goldman Sachs International | (125.524) | (0,06) |
| 797.718 | T Rowe Price Group Inc | Goldman Sachs International | (100.399) | (0,05) |
| 302.364 | T Rowe Price Group Inc | JPMorgan Chase Bank | (4.050) | (0,00) |
| 356.517 | Tesla Inc | Goldman Sachs International | (44.896) | (0,02) |
| 393.283 | Texas Instruments Inc | JPMorgan Chase Bank | (4.270) | (0,00) |
| 202.758 | Timken Co | Goldman Sachs International | (15.696) | (0,01) |
| 564.163 | Trade Desk Inc Class A | Goldman Sachs International | (82.424) | (0,04) |
| 171.949 | Upbound Group Inc | Goldman Sachs International | (33.322) | (0,02) |
| 524.827 | Walt Disney Co | Goldman Sachs International | (26.539) | (0,01) |
| 156.698 | Waters Corp | JPMorgan Chase Bank | (4.463) | (0,00) |
| Gesamtverlust aus Differenzkontrakten [∞] | | | (2.740.096) | (1,40) |

US Long Short Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Total Return Swap-Kontrakte (2,37 %) (31. Dezember 2022: (0,32 %))

| | Nominalwert | Datum der Schließung | Variabler Zinssatz | Referenzunternehmen | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|-------------|----------------------|--------------------|--|---------------------------------|----------------------|
| USD | (111.720) | 19.11.2024 | 4,57 ¹ | S&P Retail Select Industry Index ² | (18.312) | (0,01) |
| USD | (274.838) | 19.11.2024 | 4,57 ¹ | S&P Retail Select Industry Index ² | (23.470) | (0,01) |
| USD | (336.169) | 19.06.2024 | 4,93 ³ | Goldman Sachs GSCBOEC1 Index ⁴ | (85.623) | (0,04) |
| USD | (1.089.980) | 19.11.2024 | 4,57 ¹ | S&P Retail Select Industry Index ² | (95.606) | (0,05) |
| USD | (1.554.290) | 02.05.2025 | 5,73 ⁵ | S&P 500 Equal Weight Total Return Index ² | (185.450) | (0,09) |
| USD | (1.660.913) | 19.11.2024 | 4,57 ¹ | S&P Retail Select Industry Index ² | (366.056) | (0,19) |
| USD | (1.081.233) | 19.01.2024 | 4,93 ³ | Goldman Sachs GSCBOEC1 Index ⁴ | (401.924) | (0,20) |
| USD | (3.498.340) | 01.11.2024 | 4,67 ¹ | JPMorgan Basket JPNBGCND ² | (442.127) | (0,23) |
| USD | (3.796.688) | 19.07.2024 | 5,35 ¹ | JPMorgan Basket JPNBLQGS ² | (1.070.940) | (0,55) |
| USD | (4.397.105) | 19.01.2024 | 4,93 ³ | Goldman Sachs GSCBOEC1 Index ⁴ | (1.946.485) | (1,00) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Total Return Swap-Kontrakten [∞] | | | | | (4.635.993) | (2,37) |

¹ Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist die 1-Tages-Overnight Bank Funding Rate.

² Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist die JPMorgan Chase Bank.

³ Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist die 1-Tages-Overnight Fed Funds Effective Rate.

⁴ Die Gegenpartei für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist Goldman Sachs International.

⁵ Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist die USD Secured Overnight Financing Rate.

| | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|---|--------------------|----------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (8.738.101) | (4,47) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | 173.445.848 | 88,73 |
| Sonstiges Nettovermögen | 22.024.443 | 11,27 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | 195.470.291 | 100,00 |

| Portfolioanalyse | US\$ | % des Gesamtvermögens |
|---|--------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 171.484.270 | 83,10 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 6.303.715 | 3,05 |
| † Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente | 487.831 | 0,24 |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | (1.019.142) | (0,49) |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap | (3.810.826) | (1,85) |
| Anlagen insgesamt | 173.445.848 | 84,05 |

US Multi Cap Opportunities - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|--|------------------------------------|------------------|------------------------------|
| Aktien 99,12 % (31. Dezember 2022: 99,48 %) | | | |
| US-Dollar | | | |
| 141.000 | Alphabet Inc Class C | 19.871.130 | 4,96 |
| 90.000 | Amazon.com Inc | 13.674.600 | 3,41 |
| 98.000 | Apollo Global Management Inc | 9.132.620 | 2,28 |
| 87.000 | Apple Inc | 16.750.110 | 4,18 |
| 390.000 | Aramark | 10.959.000 | 2,74 |
| 33.000 | Avery Dennison Corp | 6.671.280 | 1,67 |
| 83.000 | Ball Corp | 4.774.160 | 1,19 |
| 38.000 | Becton Dickinson & Co | 9.265.540 | 2,31 |
| 57.000 | Berkshire Hathaway Inc Class B | 20.329.620 | 5,08 |
| 85.000 | BJ's Wholesale Club Holdings Inc | 5.666.100 | 1,41 |
| 800 | Booking Holdings Inc | 2.837.776 | 0,71 |
| 375.000 | Brookfield Corp | 15.045.000 | 3,76 |
| 150.500 | Brookfield Renewable Corp Class A | 4.332.895 | 1,08 |
| 77.000 | Charles Schwab Corp | 5.297.600 | 1,32 |
| 42.000 | Chubb Ltd | 9.492.000 | 2,37 |
| 375.000 | CSX Corp | 13.001.250 | 3,25 |
| 12.500 | Deere & Co | 4.998.375 | 1,25 |
| 45.000 | Eagle Materials Inc | 9.127.800 | 2,28 |
| 71.000 | EOG Resources Inc | 8.587.450 | 2,14 |
| 610.000 | Graphic Packaging Holding Co | 15.036.500 | 3,75 |
| 52.000 | HCA Healthcare Inc | 14.075.360 | 3,51 |
| 60.000 | Intercontinental Exchange Inc | 7.705.800 | 1,92 |
| 75.000 | JPMorgan Chase & Co | 12.757.500 | 3,19 |
| 26.000 | Lowe's Cos Inc | 5.786.300 | 1,45 |
| 28.500 | McDonald's Corp | 8.450.535 | 2,11 |
| 51.000 | Microsoft Corp | 19.178.040 | 4,79 |
| 115.000 | Mondelez International Inc Class A | 8.329.450 | 2,08 |
| 39.000 | Motorola Solutions Inc | 12.210.510 | 3,05 |
| 25.000 | NIKE Inc Class B | 2.714.250 | 0,68 |
| 35.000 | Nordson Corp | 9.245.600 | 2,31 |
| 47.000 | Oracle Corp | 4.955.210 | 1,24 |
| 70.000 | Pfizer Inc | 2.015.300 | 0,50 |
| 45.000 | QUALCOMM Inc | 6.508.350 | 1,63 |
| 18.500 | Rockwell Automation Inc | 5.743.880 | 1,43 |
| 59.000 | RTX Corp | 4.964.260 | 1,24 |
| 140.000 | Simply Good Foods Co | 5.544.000 | 1,38 |
| 62.000 | TJX Cos Inc | 5.816.220 | 1,45 |
| 73.000 | T-Mobile US Inc | 11.704.090 | 2,92 |
| 58.000 | TransUnion | 3.985.180 | 1,00 |

US Multi Cap Opportunities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|--|--------------------|----------------------|
| Aktien 99,12 % (31. Dezember 2022: 99,48 %) (Fortsetzung) | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | |
| 230.000 | US Foods Holding Corp | 10.444.300 | 2,61 |
| 50.000 | Veralto Corp | 4.113.000 | 1,03 |
| 26.800 | Verisk Analytics Inc Class A | 6.401.448 | 1,60 |
| 245.000 | Vestis Corp | 5.179.300 | 1,29 |
| 40.000 | Walt Disney Co | 3.611.600 | 0,90 |
| 15.000 | WD-40 Co | 3.586.050 | 0,90 |
| 56.000 | Westinghouse Air Brake Technologies Corp | 7.106.400 | 1,77 |
| Aktien insgesamt * | | 396.982.739 | 99,12 |
| Anlagen insgesamt | | 396.982.739 | 99,12 |

Devisenterminkontrakte 0,46 % (31. Dezember 2022: 0,62 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> | | | | | | |
| 309.370 AUD | 203.525 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 10 | 7.686 | 0,00 |
| 44.702 AUD | 29.202 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | 1.316 | 0,00 |
| 6.414.487 AUD | 4.133.475 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 49 | 245.732 | 0,06 |
| 33.511 US\$ | 48.887 AUD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | 135 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 440.742 € | 478.539 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 4 | 8.630 | 0,00 |
| 4.559.276 € | 4.867.842 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 12 | 171.697 | 0,04 |
| 4.163.917 € | 4.441.972 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 22 | 160.563 | 0,04 |
| 4 US\$ | 3 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | 1 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i> | | | | | | |
| 26.365.512 SGD | 19.409.150 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 7 | 592.968 | 0,15 |
| 430.097 SGD | 323.615 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | 2.678 | 0,00 |
| 6.273.972 SGD | 4.661.567 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 74 | 98.165 | 0,03 |
| 6.589 US\$ | 8.666 SGD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | 13 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i> | | | | | | |
| 23.498 US\$ | 430.060 ZAR | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | 12 | 0,00 |
| 188.922.504 ZAR | 9.812.173 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 16 | 504.741 | 0,13 |
| 6.775.352 ZAR | 367.493 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 4 | 2.503 | 0,00 |
| 21.096.132 ZAR | 1.104.994 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 48 | 47.052 | 0,01 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ~ | | | | | 1.843.892 | 0,46 |

| | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|--------------------|----------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 398.826.631 | 99,58 |

US Multi Cap Opportunities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,08 %) (31. Dezember 2022: (0,13 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> | | | | | | |
| 21.743 AUD | 14.884 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (40) | (0,00) |
| 57.926 US\$ | 91.149 AUD | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | (4.303) | (0,00) |
| 43.110 US\$ | 67.061 AUD | 18.01.2024 | UBS AG | 3 | (2.672) | (0,00) |
| 2.110.656 US\$ | 3.268.260 AUD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 29 | (120.603) | (0,03) |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 56.302 € | 62.382 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (149) | (0,00) |
| 259.220 US\$ | 240.689 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | (6.822) | (0,00) |
| 661.661 US\$ | 617.379 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 26 | (20.752) | (0,01) |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i> | | | | | | |
| 232.425 SGD | 176.340 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | (11) | (0,00) |
| 355.916 US\$ | 486.316 SGD | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | (13.026) | (0,00) |
| 750.752 US\$ | 1.010.428 SGD | 18.01.2024 | UBS AG | 4 | (15.806) | (0,00) |
| 812.239 US\$ | 1.103.644 SGD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 47 | (25.034) | (0,01) |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i> | | | | | | |
| 601.473 US\$ | 11.394.678 ZAR | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 7 | (20.781) | (0,01) |
| 130.705 US\$ | 2.492.102 ZAR | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | (5.387) | (0,00) |
| 3.771.483 US\$ | 70.702.645 ZAR | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 60 | (89.532) | (0,02) |
| 2.832.221 ZAR | 154.848 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (182) | (0,00) |
| 1.891.154 ZAR | 103.344 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | (70) | (0,00) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | (325.170) | (0,08) |
| | | | | | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | | | | | (325.170) | (0,08) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | | | | | 398.501.461 | 99,50 |
| Sonstiges Nettovermögen | | | | | 1.990.574 | 0,50 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | | | | | 400.492.035 | 100,00 |
| Portfolioanalyse | | | | | US\$ | % des Gesamtvermögens |
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | | | | | 396.982.739 | 98,08 |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente | | | | | 1.518.722 | 0,38 |
| Anlagen insgesamt | | | | | 398.501.461 | 98,46 |

US Real Estate Securities - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|-------------------------------------|--------------------|----------------------|
| Immobilienaktiengesellschaften 97,54 % (31. Dezember 2022: 96,38 %) | | | |
| US-Dollar | | | |
| 121.919 | American Homes 4 Rent Class A | 4.384.207 | 0,82 |
| 219.683 | American Tower Corp | 47.425.166 | 8,90 |
| 439.835 | Apartment Income REIT Corp | 15.275.470 | 2,86 |
| 55.010 | AvalonBay Communities Inc | 10.298.972 | 1,93 |
| 90.198 | Boston Properties Inc | 6.329.194 | 1,19 |
| 220.826 | Crown Castle Inc | 25.436.947 | 4,77 |
| 22.234 | EastGroup Properties Inc | 4.080.828 | 0,77 |
| 48.934 | Equinix Inc | 39.410.954 | 7,39 |
| 141.468 | Equity LifeStyle Properties Inc | 9.979.153 | 1,87 |
| 167.245 | Equity Residential | 10.228.704 | 1,92 |
| 62.173 | Essex Property Trust Inc | 15.415.174 | 2,89 |
| 144.883 | Extra Space Storage Inc | 23.229.091 | 4,36 |
| 1.689.358 | Hudson Pacific Properties Inc | 15.727.923 | 2,95 |
| 231.967 | Invitation Homes Inc | 7.912.394 | 1,48 |
| 197.062 | Iron Mountain Inc | 13.790.399 | 2,59 |
| 719.534 | Kimco Realty Corp | 15.333.270 | 2,88 |
| 225.732 | Omega Healthcare Investors Inc | 6.920.943 | 1,30 |
| 324.653 | Prologis Inc | 43.276.245 | 8,12 |
| 125.588 | Public Storage | 38.304.340 | 7,18 |
| 343.674 | Realty Income Corp | 19.733.761 | 3,70 |
| 87.265 | Regency Centers Corp | 5.846.755 | 1,10 |
| 331.087 | Retail Opportunity Investments Corp | 4.645.151 | 0,87 |
| 116.925 | Rexford Industrial Realty Inc | 6.559.492 | 1,23 |
| 73.893 | SBA Communications Corp Class A | 18.745.915 | 3,52 |
| 162.548 | Simon Property Group Inc | 23.185.847 | 4,35 |
| 110.587 | Sun Communities Inc | 14.779.953 | 2,77 |
| 326.027 | Urban Edge Properties | 5.966.294 | 1,12 |
| 301.129 | Ventas Inc | 15.008.269 | 2,81 |
| 556.658 | VICI Properties Inc Class A | 17.746.257 | 3,33 |
| 234.529 | Welltower Inc | 21.147.480 | 3,97 |
| 398.852 | Weyerhaeuser Co | 13.868.084 | 2,60 |
| Immobilienaktiengesellschaften insgesamt * | | 519.992.632 | 97,54 |
| Anlagen insgesamt | | 519.992.632 | 97,54 |

Devisenterminkontrakte 0,44 % (31. Dezember 2022: 0,63 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> | | | | | | |
| 2.873.492 AUD | 1.881.598 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 12 | 80.152 | 0,02 |
| 93.559 AUD | 61.784 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | 2.089 | 0,00 |

US Real Estate Securities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 0,44 % (31. Dezember 2022: 0,63 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|---------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen AUD (Fortsetzung)</i> | | | | | | |
| 18.939.439 AUD | 12.234.992 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 56 | 695.063 | 0,13 |
| 22.598 US\$ | 32.922 AUD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 4 | 122 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> | | | | | | |
| 46.624 CHF | 53.451 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 2 | 2.035 | 0,00 |
| 276.345 CHF | 314.116 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 12 | 14.756 | 0,00 |
| 1.451.336 CHF | 1.623.510 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 11 | 103.698 | 0,02 |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 923.859 € | 1.001.049 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 5 | 20.126 | 0,00 |
| 7.587.713 € | 8.102.760 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 9 | 284.223 | 0,05 |
| 7.303.172 € | 7.798.585 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 37 | 273.887 | 0,05 |
| 6.405 US\$ | 5.765 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | 33 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen HKD</i> | | | | | | |
| 2.678.511 HKD | 342.805 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 4 | 336 | 0,00 |
| 6.832.786 HKD | 874.809 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 11 | 532 | 0,00 |
| 40.927.346 HKD | 5.241.857 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 23 | 1.302 | 0,00 |
| 74.012 US\$ | 577.077 HKD | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | 83 | 0,00 |
| 33.757 US\$ | 263.178 HKD | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | 42 | 0,00 |
| 153.746 US\$ | 1.199.417 HKD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 13 | 90 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i> | | | | | | |
| 512.228 SGD | 377.288 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 10 | 11.313 | 0,00 |
| 38.604 SGD | 28.833 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 5 | 454 | 0,00 |
| 395.416 SGD | 296.359 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 46 | 3.622 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i> | | | | | | |
| 59.404 US\$ | 1.086.911 ZAR | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 4 | 49 | 0,00 |
| 318.645.195 ZAR | 16.579.353 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 16 | 821.621 | 0,16 |
| 30.019.882 ZAR | 1.619.559 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 6 | 19.805 | 0,00 |
| 20.287.353 ZAR | 1.084.466 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 45 | 23.414 | 0,01 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten [~] | | | | | 2.358.847 | 0,44 |
| | | | | | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | | | | | 522.351.479 | 97,98 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,08 %) (31. Dezember 2022: (0,19 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|----------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> | | | | | | |
| 134.183 AUD | 91.744 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (137) | (0,00) |
| 430.034 AUD | 294.511 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | (924) | (0,00) |

US Real Estate Securities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (0,08 %) (31. Dezember 2022: (0,19 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen AUD (Fortsetzung)</i> | | | | | | |
| 788.581 US\$ | 1.223.851 AUD | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 6 | (46.948) | (0,01) |
| 514.671 US\$ | 803.058 AUD | 18.01.2024 | UBS AG | 4 | (33.580) | (0,01) |
| 1.081.164 US\$ | 1.667.596 AUD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 54 | (57.313) | (0,01) |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> | | | | | | |
| 31.295 CHF | 37.303 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | (59) | (0,00) |
| 9.309 US\$ | 8.181 CHF | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (427) | (0,00) |
| 256.007 US\$ | 226.567 CHF | 18.01.2024 | UBS AG | 13 | (13.628) | (0,00) |
| 133.815 US\$ | 119.528 CHF | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 4 | (8.433) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 246.349 € | 272.836 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | (537) | (0,00) |
| 6 € | 7 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (0) | (0,00) |
| 756.505 US\$ | 703.432 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 5 | (21.026) | (0,00) |
| 1.582.822 US\$ | 1.483.642 € | 18.01.2024 | UBS AG | 3 | (57.102) | (0,01) |
| 2.763.151 US\$ | 2.585.217 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 61 | (94.391) | (0,02) |
| <i>Abgesicherte Klassen HKD</i> | | | | | | |
| 242.525 HKD | 31.118 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 1 | (49) | (0,00) |
| 4.287.478 HKD | 549.583 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 5 | (319) | (0,00) |
| 2.603.496 HKD | 333.868 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 14 | (337) | (0,00) |
| 359.080 US\$ | 2.805.445 HKD | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 4 | (322) | (0,00) |
| 165.146 US\$ | 1.289.659 HKD | 18.01.2024 | UBS AG | 3 | (71) | (0,00) |
| 1.140.954 US\$ | 8.912.870 HKD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 23 | (863) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i> | | | | | | |
| 6.071 SGD | 4.606 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (1) | (0,00) |
| 12.629 SGD | 9.582 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | (1) | (0,00) |
| 18.157 US\$ | 24.803 SGD | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | (659) | (0,00) |
| 17.509 US\$ | 23.587 SGD | 18.01.2024 | UBS AG | 4 | (385) | (0,00) |
| 46.957 US\$ | 63.244 SGD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 17 | (1.023) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i> | | | | | | |
| 1.808.703 US\$ | 34.110.867 ZAR | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 9 | (54.066) | (0,01) |
| 669.603 US\$ | 12.737.557 ZAR | 18.01.2024 | UBS AG | 3 | (25.985) | (0,01) |
| 1.477.768 US\$ | 27.465.401 ZAR | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 63 | (22.097) | (0,00) |
| 14.137.244 ZAR | 772.934 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (910) | (0,00) |
| 2.428.492 ZAR | 132.708 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 1 | (90) | (0,00) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ^o | | | | | (441.683) | (0,08) |

US Real Estate Securities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--------------------|------------------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (441.683) | (0,08) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | 521.909.796 | 97,90 |
| Sonstiges Nettovermögen | 11.200.189 | 2,10 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | 533.109.985 | 100,00 |

| Portfolioanalyse | US\$ | % des Gesamtver- mögens |
|---|--------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 519.992.632 | 96,04 |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente | 1.917.164 | 0,35 |
| Anlagen insgesamt | 521.909.796 | 96,39 |

US Small Cap - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|--|---------------------------------------|------------------|------------------------------|
| Aktien 98,17 % (31. Dezember 2022: 97,70 %) | | | |
| US-Dollar | | | |
| 37.393 | Advanced Energy Industries Inc* | 4.072.846 | 0,64 |
| 78.139 | AMERISAFE Inc* | 3.655.342 | 0,58 |
| 71.641 | Amphastar Pharmaceuticals Inc* | 4.430.996 | 0,70 |
| 46.283 | AptarGroup Inc* | 5.721.504 | 0,90 |
| 61.305 | Arcosa Inc* | 5.066.245 | 0,80 |
| 46.889 | Asbury Automotive Group Inc* | 10.548.618 | 1,66 |
| 32.766 | Aspen Technology Inc* | 7.213.435 | 1,14 |
| 7.966 | Atrion Corp* | 3.017.441 | 0,48 |
| 52.980 | Bank of Hawaii Corp* | 3.838.931 | 0,61 |
| 135.203 | Bio-Techne Corp* | 10.432.264 | 1,65 |
| 37.206 | Bright Horizons Family Solutions Inc* | 3.506.293 | 0,55 |
| 6.549 | Cable One Inc* | 3.645.108 | 0,57 |
| 74.299 | Cactus Inc Class A* | 3.373.175 | 0,53 |
| 22.063 | Casella Waste Systems Inc Class A* | 1.885.504 | 0,30 |
| 27.138 | CBIZ Inc* | 1.698.567 | 0,27 |
| 20.587 | Chemed Corp* | 12.038.248 | 1,90 |
| 27.107 | Church & Dwight Co Inc* | 2.563.238 | 0,40 |
| 9.093 | Colliers International Group Inc* | 1.150.446 | 0,18 |
| 120.818 | Community Bank System Inc* | 6.295.826 | 0,99 |
| 63.837 | CommVault Systems Inc* | 5.097.384 | 0,80 |
| 8.969 | CorVel Corp* | 2.217.227 | 0,35 |
| 24.013 | CRA International Inc* | 2.373.685 | 0,37 |
| 16.294 | Crane Co* | 1.924.973 | 0,30 |
| 48.907 | CSW Industrials Inc* | 10.143.801 | 1,60 |
| 58.569 | Cullen/Frost Bankers Inc* | 6.354.151 | 1,00 |
| 56.425 | Eagle Materials Inc* | 11.445.247 | 1,81 |
| 226.543 | Element Solutions Inc* | 5.242.205 | 0,83 |
| 76.757 | ESAB Corp* | 6.648.691 | 1,05 |
| 31.175 | ESCO Technologies Inc* | 3.648.410 | 0,58 |
| 101.227 | Exponent Inc* | 8.912.025 | 1,41 |
| 13.554 | Fair Isaac Corp* | 15.776.991 | 2,49 |
| 11.500 | Federal Signal Corp* | 882.510 | 0,14 |
| 135.491 | First Financial Bankshares Inc* | 4.105.377 | 0,65 |
| 63.930 | FirstService Corp* | 10.362.414 | 1,63 |
| 59.431 | Floor & Decor Holdings Inc Class A* | 6.630.122 | 1,05 |
| 85.547 | Fox Factory Holding Corp* | 5.772.712 | 0,91 |
| 48.882 | FTI Consulting Inc* | 9.734.850 | 1,54 |
| 122.704 | Glacier Bancorp Inc* | 5.070.129 | 0,80 |
| 73.335 | Graco Inc* | 6.362.545 | 1,00 |

US Small Cap - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|----------------------------------|---------------|----------------------|
| Aktien 98,17 % (31. Dezember 2022: 97,70 %) (Fortsetzung) | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | |
| 85.445 | Grocery Outlet Holding Corp* | 2.303.597 | 0,36 |
| 119.734 | Haemonetics Corp* | 10.238.454 | 1,61 |
| 150.632 | Hagerty Inc Class A* | 1.174.930 | 0,19 |
| 27.485 | Hamilton Lane Inc Class A* | 3.117.898 | 0,49 |
| 306.024 | Hayward Holdings Inc* | 4.161.926 | 0,66 |
| 359.027 | Hillman Solutions Corp* | 3.306.639 | 0,52 |
| 40.244 | Houlihan Lokey Inc Class A* | 4.825.658 | 0,76 |
| 20.521 | ICON Plc* | 5.808.880 | 0,92 |
| 24.745 | Jack Henry & Associates Inc* | 4.043.580 | 0,64 |
| 40.605 | Kadant Inc* | 11.381.988 | 1,80 |
| 127.563 | Kirby Corp* | 10.011.144 | 1,58 |
| 46.231 | Lakeland Financial Corp* | 3.012.412 | 0,47 |
| 176.798 | Lattice Semiconductor Corp* | 12.197.294 | 1,92 |
| 32.633 | LCI Industries* | 4.102.294 | 0,65 |
| 35.628 | Lindsay Corp* | 4.601.713 | 0,73 |
| 42.393 | Littelfuse Inc* | 11.342.671 | 1,79 |
| 64.542 | Manhattan Associates Inc* | 13.897.183 | 2,19 |
| 10.929 | MarketAxess Holdings Inc* | 3.200.558 | 0,50 |
| 68.328 | Matador Resources Co* | 3.885.130 | 0,61 |
| 39.296 | MKS Instruments Inc* | 4.042.380 | 0,64 |
| 142.507 | Model N Inc* | 3.837.714 | 0,61 |
| 87.067 | NetScout Systems Inc* | 1.911.121 | 0,30 |
| 57.295 | Nexstar Media Group Inc Class A* | 8.980.991 | 1,42 |
| 24.761 | Nordson Corp* | 6.540.866 | 1,03 |
| 36.418 | Novanta Inc* | 6.133.155 | 0,97 |
| 201.363 | Oceaneering International Inc* | 4.285.005 | 0,68 |
| 23.397 | Omega Flex Inc* | 1.649.723 | 0,26 |
| 34.423 | Pool Corp* | 13.724.794 | 2,16 |
| 124.599 | Power Integrations Inc* | 10.230.824 | 1,61 |
| 68.117 | Prosperity Bancshares Inc* | 4.613.564 | 0,73 |
| 16.785 | Quaker Chemical Corp* | 3.582.255 | 0,56 |
| 74.528 | Qualys Inc* | 14.628.356 | 2,31 |
| 35.900 | QuidelOrtho Corp* | 2.645.830 | 0,42 |
| 44.742 | RBC Bearings Inc* | 12.746.548 | 2,01 |
| 105.513 | Richelieu Hardware Ltd** | 3.839.310 | 0,61 |
| 44.364 | RLI Corp* | 5.905.736 | 0,93 |
| 16.016 | Rogers Corp* | 2.115.233 | 0,33 |
| 109.185 | Rollins Inc* | 4.768.109 | 0,75 |
| 50.904 | Shift4 Payments Inc Class A* | 3.784.203 | 0,60 |

US Small Cap - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|------------------------------------|--------------------|----------------------|
| Aktien 98,17 % (31. Dezember 2022: 97,70 %) (Fortsetzung) | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | |
| 77.552 | Simply Good Foods Co* | 3.071.059 | 0,48 |
| 61.374 | Simulations Plus Inc* | 2.746.487 | 0,43 |
| 24.253 | SiteOne Landscape Supply Inc* | 3.941.113 | 0,62 |
| 240.059 | Sitio Royalties Corp Class A* | 5.643.787 | 0,89 |
| 732.554 | Southwestern Energy Co* | 4.798.229 | 0,76 |
| 67.623 | SPS Commerce Inc* | 13.108.042 | 2,07 |
| 74.392 | SPX Technologies Inc* | 7.514.336 | 1,19 |
| 33.641 | Standex International Corp* | 5.328.062 | 0,84 |
| 142.724 | Stevanato Group SpA* | 3.894.938 | 0,61 |
| 47.318 | Stewart Information Services Corp* | 2.779.933 | 0,44 |
| 59.889 | Stock Yards Bancorp Inc* | 3.083.685 | 0,49 |
| 60.233 | TechTarget Inc* | 2.099.722 | 0,33 |
| 52.827 | Tetra Tech Inc* | 8.818.411 | 1,39 |
| 1.574 | Texas Pacific Land Corp* | 2.475.036 | 0,39 |
| 62.223 | Texas Roadhouse Inc Class A* | 7.605.517 | 1,20 |
| 115.368 | Tidewater Inc* | 8.319.187 | 1,31 |
| 82.578 | Toro Co* | 7.926.662 | 1,25 |
| 20.682 | Tractor Supply Co* | 4.447.250 | 0,70 |
| 42.721 | Transcat Inc* | 4.670.687 | 0,74 |
| 338.431 | Transocean Ltd* | 2.149.037 | 0,34 |
| 14.549 | Tyler Technologies Inc* | 6.083.228 | 0,96 |
| 35.028 | UFP Technologies Inc* | 6.026.217 | 0,95 |
| 155.576 | United Community Banks Inc* | 4.552.154 | 0,72 |
| 164.464 | Utz Brands Inc* | 2.670.895 | 0,42 |
| 40.334 | Valmont Industries Inc* | 9.418.392 | 1,49 |
| 149.819 | Vertex Inc Class A* | 4.036.124 | 0,64 |
| 29.301 | Viper Energy Inc Class A* | 919.465 | 0,14 |
| 17.810 | Watsco Inc* | 7.631.051 | 1,20 |
| 23.118 | WD-40 Co* | 5.526.820 | 0,87 |
| 17.590 | West Pharmaceutical Services Inc* | 6.193.791 | 0,98 |
| 12.869 | Winmark Corp* | 5.373.451 | 0,85 |
| | Aktien insgesamt | 622.291.910 | 98,17 |
| | Anlagen insgesamt | 622.291.910 | 98,17 |

Devisenterminkontrakte 0,12 % (31. Dezember 2022: 0,16 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> | | | | | | |
| 663.184 AUD | 438.432 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 11 | 14.327 | 0,00 |
| 102.572 AUD | 67.141 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | 2.885 | 0,00 |

US Small Cap - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 0,12 % (31. Dezember 2022: 0,16 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|-----------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen AUD (Fortsetzung)</i> | | | | | | |
| 5.870.939 AUD | 3.798.314 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 65 | 209.810 | 0,04 |
| 44.051 US\$ | 64.271 AUD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | 173 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 820.150 € | 890.872 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 7 | 15.671 | 0,00 |
| 5.614.812 € | 6.000.947 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 8 | 205.316 | 0,03 |
| 5.491.825 € | 5.856.660 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 32 | 213.660 | 0,04 |
| 2.046 US\$ | 1.841 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | 11 | 0,00 |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i> | | | | | | |
| 478 US\$ | 8.752 ZAR | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 3 | 0 | 0,00 |
| 30.419.765 ZAR | 1.581.114 US\$ | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 14 | 80.087 | 0,01 |
| 1.874.208 ZAR | 101.065 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 4 | 1.284 | 0,00 |
| 2.467.135 ZAR | 130.584 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 57 | 4.146 | 0,00 |
| Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | 747.370 | 0,12 |
| | | | | | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | | | | | 623.039.280 | 98,29 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,02 %) (31. Dezember 2022: (0,04 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> | | | | | | |
| 96.488 AUD | 66.076 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | (204) | (0,00) |
| 202.850 US\$ | 318.229 AUD | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 6 | (14.406) | (0,00) |
| 101.170 US\$ | 156.820 AUD | 18.01.2024 | UBS AG | 3 | (5.892) | (0,00) |
| 294.871 US\$ | 453.035 AUD | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 22 | (14.418) | (0,00) |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> | | | | | | |
| 141.582 € | 156.871 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (375) | (0,00) |
| 5.416 € | 6.018 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | (33) | (0,00) |
| 370.796 US\$ | 345.198 € | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 3 | (10.764) | (0,00) |
| 507.722 US\$ | 473.303 € | 18.01.2024 | UBS AG | 5 | (15.437) | (0,01) |
| 2.095.460 US\$ | 1.950.590 € | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 35 | (60.600) | (0,01) |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i> | | | | | | |
| 195.113 US\$ | 3.683.472 ZAR | 18.01.2024 | Goldman Sachs International | 11 | (6.040) | (0,00) |
| 25.308 US\$ | 482.777 ZAR | 18.01.2024 | UBS AG | 2 | (1.057) | (0,00) |
| 351.844 US\$ | 6.586.479 ZAR | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 29 | (7.838) | (0,00) |
| 1.060.425 ZAR | 57.977 US\$ | 18.01.2024 | UBS AG | 1 | (68) | (0,00) |
| 316.209 ZAR | 17.281 US\$ | 18.01.2024 | Westpac Banking Corp | 2 | (12) | (0,00) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | (137.144) | (0,02) |

US Small Cap - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| | Zeitwert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--------------------|------------------------------|
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (137.144) | (0,02) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | 622.902.136 | 98,27 |
| Sonstiges Nettovermögen | 10.949.633 | 1,73 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | 633.851.769 | 100,00 |

| Portfolioanalyse | US\$ | % des Gesamtver- mögens |
|---|--------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 618.452.600 | 96,92 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 3.839.310 | 0,60 |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente | 610.226 | 0,10 |
| Anlagen insgesamt | 622.902.136 | 97,62 |

US Small Cap Intrinsic Value - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Netto- vermögens |
|--|--|------------------|------------------------------|
| Aktien 93,24 % (31. Dezember 2022: 95,19 %) | | | |
| US-Dollar | | | |
| 84.415 | Acadia Healthcare Co Inc | 6.564.110 | 2,04 |
| 380.398 | Accuray Inc | 1.076.526 | 0,33 |
| 248.494 | Adeia Inc | 3.078.841 | 0,96 |
| 86.096 | AerCap Holdings NV | 6.398.655 | 1,99 |
| 32.377 | ALLETE Inc | 1.980.177 | 0,62 |
| 254.609 | Amneal Pharmaceuticals Inc | 1.545.477 | 0,48 |
| 51.794 | Arcosa Inc | 4.280.256 | 1,33 |
| 15.764 | Atmos Energy Corp | 1.827.048 | 0,57 |
| 57.631 | AtriCure Inc | 2.056.850 | 0,64 |
| 60.537 | Avanos Medical Inc | 1.357.845 | 0,42 |
| 36.723 | Avery Dennison Corp | 7.423.922 | 2,31 |
| 492.501 | Babcock & Wilcox Enterprises Inc | 719.052 | 0,23 |
| 56.856 | Banc of California Inc | 763.576 | 0,24 |
| 82.926 | BankUnited Inc | 2.689.290 | 0,84 |
| 138.056 | Bloom Energy Corp Class A | 2.043.229 | 0,63 |
| 71.643 | Box Inc Class A | 1.834.777 | 0,57 |
| 31.318 | Bread Financial Holdings Inc | 1.031.615 | 0,32 |
| 69.456 | Caleres Inc | 2.134.383 | 0,66 |
| 46.405 | Cannae Holdings Inc | 905.362 | 0,28 |
| 54.920 | CEVA Inc | 1.247.233 | 0,39 |
| 14.573 | Charles River Laboratories International Inc | 3.445.057 | 1,07 |
| 30.371 | Children's Place Inc | 705.215 | 0,22 |
| 164.214 | Ciena Corp | 7.391.272 | 2,30 |
| 13.839 | Clean Harbors Inc | 2.415.044 | 0,75 |
| 305.734 | Cleveland-Cliffs Inc | 6.243.088 | 1,94 |
| 136.776 | CNX Resources Corp | 2.735.520 | 0,85 |
| 387.333 | Cognyte Software Ltd | 2.490.551 | 0,77 |
| 56.345 | Coherent Corp | 2.452.698 | 0,76 |
| 47.679 | Comerica Inc | 2.660.965 | 0,83 |
| 1.059.403 | Conduent Inc | 3.866.821 | 1,20 |
| 289.019 | Criteo SA ADR | 7.317.961 | 2,28 |
| 76.859 | Crown Holdings Inc | 7.077.945 | 2,20 |
| 95.537 | CytoSorbents Corp | 106.046 | 0,03 |
| 119.898 | Devon Energy Corp | 5.431.379 | 1,69 |
| 57.794 | Dril-Quip Inc | 1.344.866 | 0,42 |
| 144.536 | EMCORE Corp | 70.678 | 0,02 |
| 74.640 | Enerpac Tool Group Corp Class A | 2.320.558 | 0,72 |
| 6.829 | Entegris Inc | 818.251 | 0,26 |
| 329.977 | Enviri Corp | 2.969.793 | 0,92 |

US Small Cap Intrinsic Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---|---------------|----------------------|
| Aktien 93,24 % (31. Dezember 2022: 95,19 %) (Fortsetzung) | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | |
| 41.604 | Haemonetics Corp | 3.557.558 | 1,11 |
| 184.166 | Hain Celestial Group Inc | 2.016.618 | 0,63 |
| 187.703 | Huntington Bancshares Inc | 2.387.582 | 0,74 |
| 89.672 | indie Semiconductor Inc Class A | 727.240 | 0,23 |
| 208.829 | Infinera Corp | 991.938 | 0,31 |
| 337.929 | Innoviz Technologies Ltd | 854.960 | 0,27 |
| 40.928 | Integra LifeSciences Holdings Corp | 1.782.414 | 0,56 |
| 287.290 | International Game Technology Plc | 7.874.619 | 2,45 |
| 11.018 | ION Geophysical Corp | 0 | 0,00 |
| 53.191 | Itron Inc | 4.016.452 | 1,25 |
| 159.083 | KBR Inc | 8.814.789 | 2,74 |
| 380.975 | Kyndryl Holdings Inc | 7.916.660 | 2,46 |
| 498.337 | Lions Gate Entertainment Corp Class B | 5.078.054 | 1,58 |
| 97.862 | MACOM Technology Solutions Holdings Inc | 9.096.273 | 2,83 |
| 290.419 | Markforged Holding Corp | 238.143 | 0,07 |
| 47.789 | Mercury Systems Inc | 1.747.644 | 0,54 |
| 16.454 | Molina Healthcare Inc | 5.944.995 | 1,85 |
| 41.267 | New Jersey Resources Corp | 1.839.683 | 0,57 |
| 81.234 | nLight Inc | 1.096.659 | 0,34 |
| 35.051 | Northwestern Energy Group Inc | 1.783.745 | 0,55 |
| 70.976 | ODP Corp | 3.995.949 | 1,24 |
| 202.599 | Oil States International Inc | 1.375.647 | 0,42 |
| 119.246 | OneSpan Inc | 1.278.317 | 0,40 |
| 240.242 | OPENLANE Inc | 3.557.984 | 1,11 |
| 239.817 | OraSure Technologies Inc | 1.966.499 | 0,61 |
| 72.888 | Ormat Technologies Inc | 5.524.181 | 1,72 |
| 23.588 | OSI Systems Inc | 3.044.031 | 0,95 |
| 106.320 | Patterson Cos Inc | 3.024.804 | 0,94 |
| 142.914 | Patterson-UTI Energy Inc | 1.543.471 | 0,48 |
| 42.425 | Portland General Electric Co | 1.838.699 | 0,57 |
| 700.683 | Quantum Corp | 244.538 | 0,08 |
| 83.886 | Radware Ltd | 1.399.219 | 0,43 |
| 121.051 | Rambus Inc | 8.261.731 | 2,57 |
| 285.707 | Resideo Technologies Inc | 5.377.006 | 1,67 |
| 1.042.473 | Ribbon Communications Inc | 3.023.172 | 0,94 |
| 37.477 | SeaWorld Entertainment Inc | 1.979.910 | 0,62 |
| 97.814 | Semtech Corp | 2.143.105 | 0,66 |
| 323.853 | Standard BioTools Inc | 715.715 | 0,22 |
| 75.463 | Stericycle Inc | 3.739.946 | 1,16 |

US Small Cap Intrinsic Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile | Wertpapierbezeichnung | | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens | |
|--|---|--------|--------------------|----------------------|----------------------|
| Aktien 93,24 % (31. Dezember 2022: 95,19 %) (Fortsetzung) | | | | | |
| US-Dollar (Fortsetzung) | | | | | |
| 288.412 | Stratasys Ltd | | 4.118.524 | 1,28 | |
| 247.373 | TechnipFMC Plc | | 4.982.092 | 1,55 | |
| 6.492 | Teledyne Technologies Inc | | 2.897.315 | 0,90 | |
| 69.016 | Tempur Sealy International Inc | | 3.517.746 | 1,09 | |
| 418.271 | TETRA Technologies Inc | | 1.890.585 | 0,59 | |
| 67.085 | Texas Capital Bancshares Inc | | 4.335.704 | 1,35 | |
| 80.919 | TreeHouse Foods Inc | | 3.354.093 | 1,04 | |
| 14.272 | Twin Discount Inc | | 230.635 | 0,07 | |
| 210.262 | Under Armour Inc Class C | | 1.755.688 | 0,55 | |
| 391.961 | Unisys Corp | | 2.202.821 | 0,69 | |
| 72.756 | Varex Imaging Corp | | 1.491.498 | 0,46 | |
| 59.217 | Varonis Systems Inc Class B | | 2.681.346 | 0,83 | |
| 258.887 | Veeco Instruments Inc | | 8.033.264 | 2,50 | |
| 86.666 | Verint Systems Inc | | 2.342.582 | 0,73 | |
| 182.898 | Viasat Inc | | 5.111.999 | 1,59 | |
| 190.145 | Viavi Solutions Inc | | 1.914.760 | 0,60 | |
| 175.918 | Vistra Corp | | 6.776.361 | 2,11 | |
| 28.410 | Wix.com Ltd | | 3.494.998 | 1,09 | |
| 198.791 | Xperi Inc | | 2.190.677 | 0,68 | |
| 106.017 | Zimvie Inc | | 1.881.802 | 0,59 | |
| | Aktien insgesamt * | | 299.826.372 | 93,24 | |
| Immobilienaktiengesellschaften 0,59 % (31. Dezember 2022: 1,12 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 84.616 | Chatham Lodging Trust | | 907.084 | 0,28 | |
| 85.609 | RLJ Lodging Trust | | 1.003.337 | 0,31 | |
| | Immobilienaktiengesellschaften insgesamt * | | 1.910.421 | 0,59 | |
| Kapitalbetrag | Wertpapierbezeichnung | Kupon | Fälligkeitsdatum | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
| Unternehmensanleihen 0,00 % (31. Dezember 2022: 0,00 %) | | | | | |
| US-Dollar | | | | | |
| 32.000 | Ion Geophysical Escrow Corp | 8,00 % | 15.12.2025 | 0 | 0,00 |
| | Unternehmensanleihen insgesamt * | | | 0 | 0,00 |
| | Anlagen insgesamt | | | 301.736.793 | 93,83 |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | | | | 301.736.793 | 93,83 |

US Small Cap Intrinsic Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,00 %) (31. Dezember 2022: (0,00 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|-------------------------|-----------|---------------------------------|------------------------------|
| 70.545 US\$ | 10.000.000 ¥ | 04.01.2024 | Brown Brothers Harriman | 1 | (398) | (0,00) |
| Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞] | | | | | (398) | (0,00) |
| | | | | | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | | | | | (398) | (0,00) |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto | | | | | 301.736.395 | 93,83 |
| Sonstiges Nettovermögen | | | | | 19.832.222 | 6,17 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | | | | | 321.568.617 | 100,00 |
| Portfolioanalyse | | | | | US\$ | % des Gesamtvermögens |
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | | | | | 301.736.793 | 93,70 |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente | | | | | (398) | 0,00 |
| Anlagen insgesamt | | | | | 301.736.395 | 93,70 |

Bilanzen

| | Anm. | 5G Connectivity Zum 31. Dezember 2023 US\$ | Absolute Return Multi Strategy Zum 31. Dezember 2023* US\$ | China A-Share Equity Zum 31. Dezember 2023 CNY | China Bond Zum 31. Dezember 2023 CNY | China Equity Zum 31. Dezember 2023 US\$ | Climate Innovation Zum 31. Dezember 2023 US\$ | CLO Income Zum 31. Dezember 2023 US\$ | Commodities Zum 31. Dezember 2023 US\$ |
|---|------|--|---|---|--|---|---|---|--|
| Umlaufvermögen | | | | | | | | | |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2 | 996.857.530 | 6.311 | 13.480.937 | 447.117.129 | 172.463.571 | 2.831.398 | 179.297.062 | 122.546.345 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 3 | 43.643.862 | 98.859 | 1.074.845 | 9.446.611 | 6.017.190 | 83.875 | 12.287.210 | 33.206.631 |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen | | 11.966.904 | 737 | 26.607 | – | 908.831 | 27.029 | – | 306 |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen | | 871.569 | – | – | – | – | – | – | 589.538 |
| Forderungen gegenüber Brokern | | – | – | – | 682.867 | – | – | – | 7.330.000 |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen | | 360.533 | 1.078 | 192.783 | 5.178.845 | 92.331 | 14.640 | 3.974.020 | 662.121 |
| Vermögenswerte insgesamt | | 1.053.700.398 | 106.985 | 14.775.172 | 462.425.452 | 179.481.923 | 2.956.942 | 195.558.292 | 164.334.941 |
| Kurzfristige Verbindlichkeiten | | | | | | | | | |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2 | 1.033.321 | – | – | 2.361.945 | 423.344 | – | 2.570.754 | 210.126 |
| Kontenüberziehung | 4 | 68 | – | – | – | – | – | – | – |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen | | 5.027.207 | – | – | 637.738 | 561.527 | – | – | 90.830 |
| Antizipative Passiva | | 1.457.148 | 11.217 | 359.457 | 422.278 | 244.205 | 3.183 | 149.265 | 135.790 |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen | | 2.582.227 | – | 150.009 | 606 | 451 | 27.707 | 7.173.352 | 10.239.576 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | 73.484 | 95.768 | 51.874 | 156.777 | 26.109 | 3.497 | 18.616 | 12.060 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | | 10.173.455 | 106.985 | 561.340 | 3.579.344 | 1.255.636 | 34.387 | 9.911.987 | 10.688.382 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | | 1.043.526.943 | – | 14.213.832 | 458.846.108 | 178.226.287 | 2.922.555 | 185.646.305 | 153.646.559 |

* Der Absolute Return Multi Strategy wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

Bilanzen (Fortsetzung)

| | | Corporate Hybrid Bond | Developed Market FMP – 2027 | Emerging Market Debt - Hard Currency | Emerging Market Debt - Local Currency | Emerging Market Debt Blend | Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | Emerging Markets Equity | Emerging Markets Select Equity |
|---|------|-----------------------|-----------------------------|--------------------------------------|---------------------------------------|----------------------------|---|-------------------------|--------------------------------|
| | Anm. | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2023* |
| | | EUR | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Umlaufvermögen | | | | | | | | | |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2 | 1.766.641.213 | 135.817.055 | 2.588.612.804 | 1.244.671.584 | 504.428.604 | 61.503.601 | 89.056.214 | – |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 3 | 79.423.824 | 503.437 | 2.306.275 | 34.899.630 | 15.095.815 | 2.754.078 | 3.296.182 | 163.972 |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen | | 1.744 | – | 23.722 | 838 | 252.512 | 20.345 | 194 | – |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen | | 7.249.268 | – | 8.718.437 | 1.094.199 | 178.023 | 1.182 | 25.864 | – |
| Forderungen gegenüber Brokern | | – | – | 22.175.962 | 16.010.321 | 7.902.696 | 679.691 | – | – |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen | | 30.551.766 | 1.479.818 | 55.368.515 | 25.831.472 | 10.166.996 | 915.984 | 271.103 | 20.832 |
| Vermögenswerte insgesamt | | 1.883.867.815 | 137.800.310 | 2.677.205.715 | 1.322.508.044 | 538.024.646 | 65.874.881 | 92.649.557 | 184.804 |
| Kurzfristige Verbindlichkeiten | | | | | | | | | |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2 | 7.732.130 | 393 | 15.874.903 | 27.976.015 | 8.849.676 | 679.582 | 787.152 | – |
| Kontenüberziehung | 4 | – | – | 31.716 | – | – | – | – | – |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen | | 5.064.442 | 239.940 | 8.966.177 | 781.709 | 500.516 | – | 128.823 | – |
| Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler | | – | – | – | 2.230.000 | 390.000 | – | – | – |
| Antizipative Passiva | | 1.188.602 | 100.867 | 1.919.504 | 1.023.619 | 449.175 | 70.618 | 142.423 | 47.821 |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen | | – | 35 | – | – | 393 | 243 | 409.316 | – |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | 66.178 | 1.256 | 594.760 | 4.629.054 | 1.047.079 | 56.889 | 494.342 | 136.983 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | | 14.051.352 | 342.491 | 27.387.060 | 36.640.397 | 11.236.839 | 807.332 | 1.962.056 | 184.804 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | | 1.869.816.463 | 137.457.819 | 2.649.818.655 | 1.285.867.647 | 526.787.807 | 65.067.549 | 90.687.501 | – |

* Der Emerging Markets Select Equity wurde am 7. September 2023 aufgelöst.

Bilanzen (Fortsetzung)

| | Anm. | Euro Bond | Euro Bond | European High | European | Event Driven | Global Bond | Global Diversified | Global Equity |
|---|------|-------------------|-------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| | | Zum | Absolute Return | Yield Bond | Sustainable Equity | | | Income FMP – | Megatrends |
| | | 31. Dezember | Zum | Zum | Zum | Zum | Zum | 2024 | Zum |
| | | 2023 | 31. Dezember | 31. Dezember | 31. Dezember | 31. Dezember | 31. Dezember | 31. Dezember | 31. Dezember |
| | | 2023 | 2023 | 2023 | 2023 | 2023 | 2023 | 2023 | 2023 |
| | | EUR | EUR | EUR | EUR | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Umlaufvermögen | | | | | | | | | |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2 | 10.219.503 | 33.385.909 | 387.635.250 | 171.225.790 | 120.057.191 | 111.175.172 | 144.239.599 | 141.493.045 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 3 | 127.676 | 460.317 | 16.624.528 | 1.127.268 | 13.500.176 | 1.162.072 | 11.026.949 | 5.262.402 |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen | | – | – | 10 | 1.032.578 | 253 | – | – | 1.620 |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen | | – | – | 102.548 | 443 | 441.776 | 240 | – | 788.588 |
| Forderungen gegenüber Brokern | | 217.984 | 1.822.858 | – | – | – | 802.148 | – | – |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen | | 145.715 | 473.859 | 6.544.828 | 120.283 | 10.722 | 1.061.825 | 1.098.172 | 273.742 |
| Vermögenswerte insgesamt | | 10.710.878 | 36.142.943 | 410.907.164 | 173.506.362 | 134.010.118 | 114.201.457 | 156.364.720 | 147.819.397 |
| Kurzfristige Verbindlichkeiten | | | | | | | | | |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2 | 81.140 | 1.615.336 | 1.281.452 | – | 155.365 | 3.890.491 | – | – |
| Kontenüberziehung | 4 | – | 412.247 | – | 42 | – | – | 13 | – |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen | | – | – | 98.287 | 1.292.679 | 161.583 | 14.939 | – | 3.100.333 |
| Antizipative Passiva | | 42.325 | 47.082 | 110.226 | 84.070 | 79.389 | 80.067 | 123.837 | 224.956 |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen | | – | – | 963.852 | 1.639 | 5.896.768 | 1.438.589 | – | – |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | 14.319 | 41.451 | 37.030 | 30.381 | 1.304.865 | 34.571 | 41.217 | 11.252 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | | 137.784 | 2.116.116 | 2.490.847 | 1.408.811 | 7.597.970 | 5.458.657 | 165.067 | 3.336.541 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | | 10.573.094 | 34.026.827 | 408.416.317 | 172.097.551 | 126.412.148 | 108.742.800 | 156.199.653 | 144.482.856 |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Bilanzen (Fortsetzung)

| | | Global Flexible Credit Income | Global High Yield SDG Engagement | Global High Yield Sustainable Action | Global Investment Grade Credit | Global Opportunistic Bond | Global Real Estate Securities | Global Sustainable Equity | Global Sustainable Value |
|---|------|----------------------------------|-------------------------------------|---|-----------------------------------|---------------------------------|----------------------------------|------------------------------|-----------------------------|
| | Anm. | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2023* | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2023 |
| | | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Umlaufvermögen | | | | | | | | | |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2 | 368.099.040 | 544.440.088 | – | 83.459.890 | 70.656.593 | 20.510.136 | 153.603.419 | 54.991.923 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 3 | 25.482.094 | 10.709.205 | 52.318 | 3.401.463 | 1.529.454 | 211.649 | 781.170 | 544.936 |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen | | – | 820.711 | – | – | 110.692 | – | 618.618 | – |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen | | 435.297 | 187.598 | – | – | 19.690 | 12.500 | 159.181 | 20.869 |
| Forderungen gegenüber Brokern | | 3.225.584 | – | – | – | 1.153.721 | – | – | – |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen | | 5.792.332 | 9.463.589 | 1 | 1.093.184 | 732.900 | 102.538 | 72.293 | 84.087 |
| Vermögenswerte insgesamt | | 403.034.347 | 565.621.191 | 52.319 | 87.954.537 | 74.203.050 | 20.836.823 | 155.234.681 | 55.641.815 |
| Kurzfristige Verbindlichkeiten | | | | | | | | | |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2 | 8.620.881 | 6.738.234 | – | 1.107.450 | 7.756.007 | 250.684 | – | 46.897 |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen | | 1.835.312 | 345.199 | – | – | – | 54.826 | 9.808 | 17.218 |
| Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler | | 200.000 | – | – | – | – | – | – | – |
| Antizipative Passiva | | 238.837 | 244.147 | 29.617 | 46.561 | 72.646 | 58.316 | 77.887 | 65.609 |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen | | 1.500.862 | 97.458 | – | – | 911.501 | 1 | 540.903 | 6 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | 25.474 | 32.248 | 22.702 | 22.701 | 53.133 | 12.983 | 32.788 | 46.191 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | | 12.421.366 | 7.457.286 | 52.319 | 1.176.712 | 8.793.287 | 376.810 | 661.386 | 175.921 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | | 390.612.981 | 558.163.905 | – | 86.777.825 | 65.409.763 | 20.460.013 | 154.573.295 | 55.465.894 |

* Der Global High Yield Sustainable Action wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Bilanzen (Fortsetzung)

| | | High Yield Bond | InnovAsia 5G | Japan Equity Engagement | Macro Opportunities FX | Multi-Asset Income | Next Generation Mobility | Next Generation Space Economy | Responsible Asian Debt - Hard Currency |
|---|------|-------------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|--|
| | Anm. | Zum 31. Dezember 2023 US\$ | Zum 31. Dezember 2023 US\$ | Zum 31. Dezember 2023 JPY | Zum 31. Dezember 2023 EUR | Zum 31. Dezember 2023* US\$ | Zum 31. Dezember 2023 US\$ | Zum 31. Dezember 2023 US\$ | Zum 31. Dezember 2023 US\$ |
| Umlaufvermögen | | | | | | | | | |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2 | 2.133.705.667 | 22.824.022 | 16.090.377.079 | 7.381.837 | – | 152.835.153 | 18.674.716 | 60.597.643 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 3 | 73.617.932 | 1.128.943 | 90.965.141 | 126.875 | 58.916 | 11.689.060 | 943.288 | 2.708.868 |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen | | 27.132.212 | – | – | – | – | 415.564 | 294 | – |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen | | 8.426.020 | – | 9.477.834 | 22.386 | – | 323.006 | 167.685 | – |
| Forderungen gegenüber Brokern | | – | – | – | – | – | – | – | 128.088 |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen | | 37.739.993 | 20.417 | 43.887.262 | 17.813 | 231 | 69.192 | 5.544 | 850.351 |
| Vermögenswerte insgesamt | | 2.280.621.824 | 23.973.382 | 16.234.707.316 | 7.548.911 | 59.147 | 165.331.975 | 19.791.527 | 64.284.950 |
| Kurzfristige Verbindlichkeiten | | | | | | | | | |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2 | 15.443.334 | 60.136 | 42.002.252 | 4.613.695 | – | 10.365 | – | 263.464 |
| Kontenüberziehung | 4 | – | 6.560 | 69.286 | – | – | – | – | – |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen | | 4.565.230 | 16.084 | 2.684.590 | 4.194 | – | 486.682 | – | 14.879 |
| Antizipative Passiva | | 2.119.832 | 54.304 | 11.646.832 | 33.119 | 39.739 | 276.843 | 35.580 | 50.885 |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen | | 6.528.399 | 86 | – | 44 | – | 179.180 | – | – |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | 154.310 | 66.092 | 775.641 | 16.053 | 19.408 | 22.840 | 12.017 | 13.858 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | | 28.811.105 | 203.262 | 57.178.601 | 4.667.105 | 59.147 | 975.910 | 47.597 | 343.086 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | | 2.251.810.719 | 23.770.120 | 16.177.528.715 | 2.881.806 | – | 164.356.065 | 19.743.930 | 63.941.864 |

* Der Multi-Asset Income wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

Bilanzen (Fortsetzung)

| | Anm. | Short Duration Emerging Market Debt | Short Duration High Yield SDG Engagement | Strategic Income | Sustainable Asia High Yield | Sustainable Emerging Market Corporate Debt | Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency | Tactical Macro | Ultra Short Term Euro Bond | |
|---|------|---|--|-----------------------------|--------------------------------|--|---|-----------------------------|-------------------------------|-----------------------------|
| | | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2023 |
| | | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | EUR |
| Umlaufvermögen | | | | | | | | | | |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2 | 3.882.376.064 | 692.929.732 | 2.163.075.623 | 26.910.034 | 92.566.505 | 432.174.496 | 23.429.706 | 965.478.305 | |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 3 | 14.257.955 | 44.469.256 | 55.205.634 | 1.163.077 | 3.976.271 | 7.042.532 | 3.554.300 | 11.222.572 | |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen | | 11.329.362 | 10.775.834 | 22.831.706 | – | – | – | – | – | |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen | | 5.275.293 | 336.109 | 91.892.501 | – | 30.010 | – | – | 3.219.672 | |
| Forderungen gegenüber Brokern | | 5.350.000 | – | 22.631.176 | 108.311 | 425.554 | 4.811.634 | 526.958 | 11.144.095 | |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen | | 51.967.946 | 11.302.348 | 16.507.617 | 513.607 | 1.463.373 | 7.824.139 | 6.453 | 10.766.896 | |
| Vermögenswerte insgesamt | | 3.970.556.620 | 759.813.279 | 2.372.144.257 | 28.695.029 | 98.461.713 | 451.852.801 | 27.517.417 | 1.001.831.540 | |
| Kurzfristige Verbindlichkeiten | | | | | | | | | | |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2 | 9.131.675 | 3.114.085 | 25.175.764 | 58.767 | 472.118 | 5.706.695 | 262.401 | 8.016.867 | |
| Kontenüberziehung | 4 | – | – | 377 | – | – | – | 68.223 | – | |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen | | 2.760.383 | 241.544 | 3.405.075 | 746 | 28.695 | 16.636 | – | 440.357 | |
| Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler | | – | – | 520.000 | – | – | – | – | – | |
| Antizipative Passiva | | 2.320.930 | 510.397 | 1.529.024 | 58.670 | 146.162 | 215.044 | 10.585 | 258.073 | |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen | | 1.500.740 | 11.465.702 | 321.393.124 | – | – | 90 | 93 | – | |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | 73.325 | 47.104 | 517.312 | 11.895 | 25.601 | 22.066 | 13.807 | 243.945 | |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | | 15.787.053 | 15.378.832 | 352.540.676 | 130.078 | 672.576 | 5.960.531 | 355.109 | 8.959.242 | |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | | 3.954.769.567 | 744.434.447 | 2.019.603.581 | 28.564.951 | 97.789.137 | 445.892.270 | 27.162.308 | 992.872.298 | |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Bilanzen (Fortsetzung)

| | | Uncorrelated Strategies | Uncorrelated Trading | US Equity | US Equity Index PutWrite | US Large Cap Value | US Long Short Equity | US Multi Cap Opportunities | US Real Estate Securities |
|---|------|-----------------------------|------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-------------------------------|------------------------------|
| | Anm. | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2023* | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2023 |
| | | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Umlaufvermögen | | | | | | | | | |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2 | 1.476.262.171 | – | 47.126.139 | 675.485.941 | 1.852.695.638 | 182.183.949 | 398.826.631 | 522.351.479 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 3 | 215.995.568 | 198.922 | 2.317.070 | 56.170.541 | 129.487.412 | 4.926.902 | 2.020.942 | 12.824.749 |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen | | 15.185.048 | – | 3.038 | 1.711.903 | 27.677.469 | 466.494 | 2.749.439 | 1.290.830 |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen | | 43.677.979 | – | 266.617 | 1.578.418 | 1.825.988 | 43.717 | 937.914 | 3.439.184 |
| Forderungen gegenüber Brokern | | 456.802.391 | – | – | – | – | 18.176.471 | – | – |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen | | 76.645.645 | 1.324 | 37.095 | 1.742.599 | 2.702.827 | 559.458 | 211.780 | 1.534.038 |
| Vermögenswerte insgesamt | | 2.284.568.802 | 200.246 | 49.749.959 | 736.689.402 | 2.014.389.334 | 206.356.991 | 404.746.706 | 541.440.280 |
| Kurzfristige Verbindlichkeiten | | | | | | | | | |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2 | 499.958.213 | – | 118.963 | 5.789.899 | 115.827 | 8.738.101 | 325.170 | 441.683 |
| Kontenüberziehung | 4 | 659 | – | – | – | – | – | – | – |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen | | 4.375.209 | – | 349.690 | 1.255.511 | 11.729.299 | 692.205 | 3.342.769 | 6.007.211 |
| Antizipative Passiva | | 1.133.015 | 110.069 | 74.355 | 349.539 | 1.158.780 | 280.090 | 547.484 | 895.622 |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen | | 81.242.292 | – | – | 165.070 | 62.146.829 | 14.013 | – | 941.735 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | 71.157.993 | 90.177 | 4.802 | 31.383 | 48.221 | 1.162.291 | 39.248 | 44.044 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | | 657.867.381 | 200.246 | 547.810 | 7.591.402 | 75.198.956 | 10.886.700 | 4.254.671 | 8.330.295 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | | 1.626.701.421 | – | 49.202.149 | 729.098.000 | 1.939.190.378 | 195.470.291 | 400.492.035 | 533.109.985 |

* Der Uncorrelated Trading wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

Bilanzen (Fortsetzung)

| | Anm. | US Small Cap | US Small Cap | Fonds insgesamt* |
|---|------|-------------------------------------|--|-------------------------------------|
| | | Zum 31. Dezember 2023 US\$ | Intrinsic Value Zum 31. Dezember 2023 US\$ | Zum 31. Dezember 2023 US\$ |
| Umlaufvermögen | | | | |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2 | 623.039.280 | 301.736.793 | 27.392.822.906 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 3 | 12.744.703 | 18.299.118 | 1.025.815.249 |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen | | 369 | 1.402.699 | 138.871.900 |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen | | 2.127.779 | 477.091 | 185.808.216 |
| Forderungen gegenüber Brokern | | – | – | 582.901.730 |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen | | 193.802 | 125.377 | 385.748.047 |
| Vermögenswerte insgesamt | | 638.105.933 | 322.041.078 | 29.711.968.048 |
| Kurzfristige Verbindlichkeiten | | | | |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2 | 137.144 | 398 | 688.709.657 |
| Kontenüberziehung | 4 | – | – | 563.542 |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen | | 3.284.597 | 40.900 | 72.180.295 |
| Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler | | – | – | 3.340.000 |
| Antizipative Passiva | | 639.284 | 275.610 | 22.069.430 |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen | | 154.493 | 140.859 | 517.779.908 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | 38.646 | 14.694 | 82.992.460 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | | 4.254.164 | 472.461 | 1.387.635.292 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | | 633.851.769 | 321.568.617 | 28.324.332.756 |

Direktor:
Naomi Daly

Direktor:
Gráinne Alexander

Datum: 17. April 2024

Datum: 17. April 2024

* Der konsolidierte Abschluss wurde um im Namen des Fonds gehaltener Salden und um Überkreuzinvestitionen zwischen den Portfolios bereinigt. Details zu Überkreuzinvestitionen zwischen Portfolios sind Anmerkung 10 der Anmerkungen zum geprüften Jahresabschluss zu entnehmen.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Bilanzen (Fortsetzung)

| | | 5G Connectivity | Absolute Return Multi Strategy | China A-Share Equity | China Bond | China Equity | CLO Income | Commodities | Corporate Hybrid Bond |
|---|------|-------------------------------------|--------------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|
| | Anm. | Zum 31. Dezember 2022 US\$ | Zum 31. Dezember 2022* US\$ | Zum 31. Dezember 2022 CNY | Zum 31. Dezember 2022 CNY | Zum 31. Dezember 2022 US\$ | Zum 31. Dezember 2022 US\$ | Zum 31. Dezember 2022 US\$ | Zum 31. Dezember 2022 EUR |
| Umlaufvermögen | | | | | | | | | |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2 | 965.036.484 | 6.766 | 15.317.693 | 429.085.411 | 307.949.549 | 116.138.374 | 77.727.468 | 1.684.830.088 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 3 | 34.119.654 | 93.179 | 952.930 | 22.788.957 | 8.545.056 | 20.349.795 | 8.094.998 | 124.965.163 |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen | | 3.505.517 | – | – | 19.609.680 | 2.164.762 | 934 | 5.565.123 | – |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen | | 1.012.596 | – | – | 194 | – | – | 311.481 | 1.293.606 |
| Forderungen gegenüber Brokern | | – | – | – | 839.388 | – | 320.000 | – | – |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen | | 432.516 | – | 256.475 | 44.536.205 | 227 | 2.790.144 | 202.284 | 33.042.330 |
| Vermögenswerte insgesamt | | 1.004.106.767 | 99.945 | 16.527.098 | 516.859.835 | 318.659.594 | 139.599.247 | 91.901.354 | 1.844.131.187 |
| Kurzfristige Verbindlichkeiten | | | | | | | | | |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2 | 3.280.059 | – | – | 2.739.680 | 817.712 | 1.324.169 | 333.046 | 57.668.909 |
| Kontenüberziehung | 4 | 129 | – | – | – | – | – | – | – |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen | | 1.380.674 | – | – | 1.522.147 | 1.759 | – | 11.154 | 1.782.089 |
| Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler | | – | – | – | – | – | – | 5.450.000 | – |
| Antizipative Passiva | | 1.542.416 | – | 207.005 | 367.670 | 405.069 | 106.080 | 85.152 | 1.193.107 |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen | | 4.858.404 | – | – | 58.969.849 | – | 85.088 | – | 1.276.923 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | 34.892 | 99.945 | 78.335 | 216.910 | 21.378 | 46.446 | 24.573 | 55.351 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | | 11.096.574 | 99.945 | 285.340 | 63.816.256 | 1.245.918 | 1.561.783 | 5.903.925 | 61.976.379 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | | 993.010.193 | – | 16.241.758 | 453.043.579 | 317.413.676 | 138.037.464 | 85.997.429 | 1.782.154.808 |

* Der Absolute Return Multi Strategy wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

Bilanzen (Fortsetzung)

| | | Emerging Market Debt - Hard Currency | Emerging Market Debt - Local Currency | Emerging Market Debt Blend | Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | Emerging Markets Equity | Emerging Markets Select Equity | Euro Bond | Euro Bond Absolute Return |
|---|------|--|---|-------------------------------------|--|-------------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|
| | Anm. | Zum 31. Dezember 2022 US\$ | Zum 31. Dezember 2022 US\$ | Zum 31. Dezember 2022 US\$ | Zum 31. Dezember 2022 US\$ | Zum 31. Dezember 2022 US\$ | Zum 31. Dezember 2022 US\$ | Zum 31. Dezember 2022 EUR | Zum 31. Dezember 2022 EUR |
| Umlaufvermögen | | | | | | | | | |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2 | 2.346.546.593 | 1.360.283.509 | 463.102.332 | 50.898.306 | 189.787.819 | 90.426.979 | 8.590.398 | 47.520.374 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 3 | 107.924.157 | 12.401.585 | 4.035.002 | 3.413.071 | 5.356.295 | 3.402.931 | 473.148 | 1.710.742 |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen | | – | 3.199.020 | 16.293.590 | 7.893 | – | 34.597 | 121.972 | 86.705 |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen | | 4.103.978 | 883.605 | 275.687 | – | 362.074 | 16.812 | – | 13.876.229 |
| Forderungen gegenüber Brokern | | 3.276.177 | 54.984.796 | 9.999.389 | 424.677 | – | – | 258.450 | 252.313 |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen | | 59.709.417 | 30.010.757 | 11.304.641 | 746.361 | 550.079 | 193.164 | 102.378 | 435.363 |
| Vermögenswerte insgesamt | | 2.521.560.322 | 1.461.763.272 | 505.010.641 | 55.490.308 | 196.056.267 | 94.074.483 | 9.546.346 | 63.881.726 |
| Kurzfristige Verbindlichkeiten | | | | | | | | | |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2 | 11.868.883 | 57.448.294 | 13.780.086 | 542.408 | 666.859 | – | 112.447 | 1.279.616 |
| Kontenüberziehung | 4 | – | – | – | 12 | 345 | – | – | 388 |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen | | 14.282.774 | 1.482.933 | 621.342 | 1.033 | 2.563.061 | 577 | – | 13.827.198 |
| Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler | | – | 3.980.000 | 840.000 | – | – | – | – | – |
| Antizipative Passiva | | 2.024.113 | 1.301.053 | 469.534 | 63.835 | 289.525 | 124.746 | 34.664 | 51.536 |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen | | 1.572.454 | 2.187.526 | 1.940.067 | 499.247 | 38.266 | 40.672 | 17.717 | 46.881 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | 107.170 | 9.099.023 | 17.178.132 | 109.392 | 690.456 | 146.366 | 86.776 | 148.231 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | | 29.855.394 | 75.498.829 | 34.829.161 | 1.215.927 | 4.248.512 | 312.361 | 251.604 | 15.353.850 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | | 2.491.704.928 | 1.386.264.443 | 470.181.480 | 54.274.381 | 191.807.755 | 93.762.122 | 9.294.742 | 48.527.876 |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Bilanzen (Fortsetzung)

| | | European High Yield Bond | European Sustainable Equity | Event Driven | Global Bond | Global Diversified Income FMP – 2024 | Global Equity Megatrends | Global Flexible Credit Income | Global High Yield SDG Engagement |
|---|------|-----------------------------|--------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|--|-----------------------------|----------------------------------|--|
| | Anm. | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | | EUR | EUR | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Umlaufvermögen | | | | | | | | | |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2 | 33.741.184 | 174.388.827 | 34.759.787 | 133.785.619 | 154.791.860 | 79.465.335 | 385.148.567 | 286.905.751 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 3 | 1.372.196 | 1.487.612 | 6.873.963 | 4.700.090 | 50.248.991 | 77.732 | 10.118.861 | 5.259.514 |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen | 2 | – | – | – | 834.394 | – | – | 154.968 | 71.005 |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen | | 13.705.182 | 5.007.586 | – | – | – | 40.452 | 9.991 | 123.184.909 |
| Forderungen gegenüber Brokern | | – | – | – | 376.572 | – | – | 5.284.784 | – |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen | | 544.743 | 172.097 | 8.601 | 867.942 | 1.581.894 | 115.036 | 6.555.070 | 5.725.188 |
| Vermögenswerte insgesamt | | 49.363.307 | 181.056.122 | 41.642.351 | 140.564.617 | 206.622.745 | 79.698.555 | 407.272.241 | 421.146.367 |
| Kurzfristige Verbindlichkeiten | | | | | | | | | |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2 | 3.113.019 | – | 18.616 | 2.112.792 | 417 | – | 12.005.976 | 9.426.254 |
| Kontenüberziehung | 4 | – | – | – | – | – | – | – | 15 |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen | | 13.707.154 | 3.727.664 | – | – | 46.050.000 | 134.741 | 28.122 | 144.749 |
| Antizipative Passiva | | 50.457 | 134.129 | 76.524 | 65.484 | 167.100 | 188.716 | 280.150 | 120.597 |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen | | 20.048 | 1.319.645 | – | 3.505.750 | – | 37 | 352.483 | 74.390.132 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | 18.101 | 20.454 | 100.539 | 69.295 | 9.142 | 30.696 | 79.181 | 111.242 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | | 16.908.779 | 5.201.892 | 195.679 | 5.753.321 | 46.226.659 | 354.190 | 12.745.912 | 84.192.989 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | | 32.454.528 | 175.854.230 | 41.446.672 | 134.811.296 | 160.396.086 | 79.344.365 | 394.526.329 | 336.953.378 |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Bilanzen (Fortsetzung)

| | | Global High Yield Sustainable Action | Global Investment Grade Credit | Global Opportunistic Bond | Global Real Estate Securities | Global Sustainable Equity | Global Nachhaltig Wert | High Yield Bond | InnovAsia 5G |
|---|------|---|-----------------------------------|---------------------------------|----------------------------------|------------------------------|------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| | Anm. | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Umlaufvermögen | | | | | | | | | |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2 | 14.547.172 | 83.541.497 | 80.110.952 | 38.072.868 | 130.524.482 | 47.841.138 | 2.170.021.483 | 14.325.847 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 3 | 1.033.221 | 3.565.231 | 5.863.263 | 1.125.241 | 1.070.714 | 727.506 | 134.476.435 | 596.336 |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen | | 253 | – | 406.959 | 13 | – | 270.540 | 4.627.097 | 41.445 |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen | | – | – | 14 | – | 4.411.790 | 3.427 | 3.517.926 | – |
| Forderungen gegenüber Brokern | | – | – | 1.228.672 | – | – | – | 300.000 | – |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen | | 279.956 | 882.351 | 908.005 | 119.762 | 91.089 | 113.386 | 38.784.027 | 69.903 |
| Vermögenswerte insgesamt | | 15.860.602 | 87.989.079 | 88.517.865 | 39.317.884 | 136.098.075 | 48.955.997 | 2.351.726.968 | 15.033.531 |
| Kurzfristige Verbindlichkeiten | | | | | | | | | |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2 | 358.029 | 1.642.819 | 5.529.567 | 147.763 | – | 90.456 | 25.597.669 | 78.732 |
| Kontenüberziehung | 4 | – | – | – | 86 | – | – | 149 | – |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen | | – | – | 30 | 69.724 | 4.397.123 | 727.660 | 5.887.375 | 32.016 |
| Antizipative Passiva | | 40.994 | 90.568 | 75.034 | 58.301 | 116.088 | 55.463 | 2.442.382 | 103.033 |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen | | 406.264 | – | 6.676.859 | – | 7 | 152 | 18.780.475 | 48.481 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | 8.247 | 347.050 | 130.932 | 19.590 | 6.658 | 57.825 | 267.206 | 22.276 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | | 813.534 | 2.080.437 | 12.412.422 | 295.464 | 4.519.876 | 931.556 | 52.975.256 | 284.538 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | | 15.047.068 | 85.908.642 | 76.105.443 | 39.022.420 | 131.578.199 | 48.024.441 | 2.298.751.712 | 14.748.993 |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Bilanzen (Fortsetzung)

| | | Japan Equity Engagement | Macro Opportunities FX | Multi-Asset Income | Next Generation Mobility | Next Generation Space Economy | Responsible Asian Debt -Hard Currency | Short Duration Emerging Market Debt | Short Duration High Yield SDG Engagement |
|---|------|------------------------------------|------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|---|---|--|
| | Anm. | Zum 31. Dezember 2022 JPY | Zum 31. Dezember 2022 EUR | Zum 31. Dezember 2022 US\$ | Zum 31. Dezember 2022 US\$ | Zum 31. Dezember 2022 US\$ | Zum 31. Dezember 2022 US\$ | Zum 31. Dezember 2022 US\$ | Zum 31. Dezember 2022 US\$ |
| Umlaufvermögen | | | | | | | | | |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2 | 20.251.986.644 | 35.753.350 | 9.231.268 | 138.694.644 | 7.981.674 | 20.262.516 | 4.901.636.040 | 536.260.884 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 3 | 421.921.338 | 131.107 | 1.795.321 | 9.717.383 | 555.274 | 1.180.261 | 196.555.616 | 27.853.758 |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen | | – | 67 | 284.261 | 72.621 | – | – | 11.003 | 56.462 |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen | | – | 66.778 | 67.840 | 279.664 | 19.545 | – | 9.283.967 | 2.421.432 |
| Forderungen gegenüber Brokern | | – | – | 628.167 | – | – | 55.253 | – | – |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen | | 28.870.308 | 107.020 | 189.122 | 53.143 | 13.778 | 299.519 | 77.069.801 | 7.908.182 |
| Vermögenswerte insgesamt | | 20.702.778.290 | 36.058.322 | 12.195.979 | 148.817.455 | 8.570.271 | 21.797.549 | 5.184.556.427 | 574.500.718 |
| Kurzfristige Verbindlichkeiten | | | | | | | | | |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2 | 141.215.249 | 4.428.576 | 647.046 | 213.661 | – | 88.173 | 25.830.013 | 5.286.451 |
| Kontenüberziehung | 4 | 98.494 | – | 3.963 | – | – | – | – | – |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen | | – | 51.700 | – | 79.879 | – | 18.123 | 7.657.731 | 3.628.199 |
| Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler | | – | – | – | – | – | – | – | – |
| Antizipative Passiva | | 12.310.780 | 48.457 | 74.442 | 279.259 | 42.290 | 43.612 | 3.062.519 | 411.720 |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen | | 5.076.179 | – | 67.370 | 216.677 | 23.001 | – | 23.342.727 | 8.756.374 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | 1.410.003 | 19.433 | 37.043 | 23.302 | 14.118 | 21.432 | 1.687 | 44.295 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | | 160.110.705 | 4.548.166 | 829.864 | 812.778 | 79.409 | 171.340 | 59.894.677 | 18.127.039 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | | 20.542.667.585 | 31.510.156 | 11.366.115 | 148.004.677 | 8.490.862 | 21.626.209 | 5.124.661.750 | 556.373.679 |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Bilanzen (Fortsetzung)

| | | Strategic Income | Sustainable Asia High Yield | Sustainable Emerging Market Corporate Debt | Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency | Ultra Short Term Euro Bond | Uncorrelated Strategies | Uncorrelated Trading | US Equity |
|---|------|-----------------------------|--------------------------------|--|---|----------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| | Anm. | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | EUR | US\$ | US\$ | US\$ |
| Umlaufvermögen | | | | | | | | | |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2 | 1.454.526.951 | 28.628.399 | 92.287.239 | 147.618.248 | 808.942.173 | 2.555.941.719 | 598.691.431 | 29.642.109 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 3 | 104.978.500 | 2.770.190 | 6.953.109 | 8.625.196 | 10.039.473 | 301.147.318 | 66.208.500 | 2.395.266 |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen | | 34.551.202 | – | – | 6.851 | 7.615 | 84.079.197 | 25.143.028 | – |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen | | 5.263.162 | – | 198.096 | 2.755.712 | 606.680 | 10.881.609 | 303.985 | 7.971 |
| Forderungen gegenüber Brokern | | 3.722.665 | 58.035 | 166.695 | 199.602 | 6.612.268 | 737.006.142 | 89.712.105 | – |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen | | 13.288.492 | 679.979 | 1.542.219 | 3.029.425 | 7.293.900 | 228.604.888 | 19.269.949 | 25.906 |
| Vermögenswerte insgesamt | | 1.616.330.972 | 32.136.603 | 101.147.358 | 162.235.034 | 833.502.109 | 3.917.660.873 | 799.328.998 | 32.071.252 |
| Kurzfristige Verbindlichkeiten | | | | | | | | | |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2 | 13.465.056 | 29.229 | 141.962 | 908.488 | 10.569.827 | 489.983.868 | 59.324.225 | 546.931 |
| Kontenüberziehung | 4 | 155 | – | 1.508.656 | – | – | 22.735 | 27.694 | – |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen | | 3.707.806 | – | 177.478 | 2.726.126 | 322.425 | 2.890.689 | 223.254 | – |
| Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler | | 250.000 | – | – | – | – | 5.000 | 63.659 | – |
| Antizipative Passiva | | 1.089.994 | 70.771 | 149.274 | 117.559 | 257.172 | 2.108.050 | 1.477.266 | 47.361 |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen | | 274.300.844 | 85.047 | 809.961 | – | 608.123 | 126.044.433 | 14.876.428 | – |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | 711.262 | 29.285 | 115.719 | 62.267 | 354.495 | 166.119.116 | 11.393.762 | 12.131 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | | 293.525.117 | 214.332 | 2.903.050 | 3.814.440 | 12.112.042 | 787.173.891 | 87.386.288 | 606.423 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | | 1.322.805.855 | 31.922.271 | 98.244.308 | 158.420.594 | 821.390.067 | 3.130.486.982 | 711.942.710 | 31.464.829 |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Bilanzen (Fortsetzung)

| | | US Equity Index PutWrite | US Large Cap Value | US Long Short Equity | US Multi Cap Opportunities | US Real Estate Securities | US Small Cap | US Small Cap Intrinsic Value | Fonds insgesamt* |
|---|------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-------------------------------|------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|-----------------------------|
| | Anm. | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Umlaufvermögen | | | | | | | | | |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2 | 648.856.403 | 1.689.599.584 | 179.143.690 | 441.762.007 | 628.621.129 | 579.729.131 | 186.889.372 | 27.511.074.629 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 3 | 44.491.927 | 75.198.123 | 34.444.171 | 1.259.174 | 21.884.190 | 10.674.691 | 8.840.096 | 1.518.644.441 |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen | | 3.987.199 | 17.011.441 | 8.813.281 | 2.155.112 | 96 | 109.183 | 1.398.733 | 217.909.539 |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen | | 567.528 | 5.505.395 | 289.671 | 823.707 | 3.580.698 | 1.178.559 | 491.844 | 217.511.029 |
| Forderungen gegenüber Brokern | | – | – | 11.644.215 | – | – | – | – | 927.110.748 |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen | | 379.288 | 1.854.555 | 891.436 | 219.477 | 1.956.405 | 2.524.308 | 66.145 | 573.072.046 |
| Vermögenswerte insgesamt | | 698.282.345 | 1.789.169.098 | 235.226.464 | 446.219.477 | 656.042.518 | 594.215.872 | 197.686.190 | 30.965.322.432 |
| Kurzfristige Verbindlichkeiten | | | | | | | | | |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2 | 14.283.196 | 102.612 | 2.889.863 | 587.402 | 1.230.032 | 236.699 | – | 846.692.109 |
| Kontenüberziehung | 4 | – | – | – | – | – | – | – | 1.565.099 |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen | | 543.568 | 494.764 | 1.227.732 | 1.019.084 | 3.412.368 | 780.783 | 287.203 | 142.576.198 |
| Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler | | – | – | – | – | – | – | – | 10.588.659 |
| Antizipative Passiva | | 366.712 | 1.065.730 | 329.297 | 631.626 | 1.318.524 | 654.722 | 196.002 | 25.893.180 |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen | | 2.608.050 | 19.542.707 | 91.888 | 2.618.414 | 1.982.404 | 129.484 | 2.170.492 | 605.080.476 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | 24.081 | 8.926 | 9.157.783 | 47.001 | 73.395 | 35.517 | 991.453 | 218.544.490 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | | 17.825.607 | 21.214.739 | 13.696.563 | 4.903.527 | 8.016.723 | 1.837.205 | 3.645.150 | 1.850.940.211 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen | | 680.456.738 | 1.767.954.359 | 221.529.901 | 441.315.950 | 648.025.795 | 592.378.667 | 194.041.040 | 29.114.382.221 |

* Der konsolidierte Abschluss wurde um im Namen des Fonds gehaltener Salden und um Überkreuzinvestitionen zwischen den Portfolios bereinigt. Details zu Überkreuzinvestitionen zwischen Portfolios sind Anmerkung 10 der Anmerkungen zum geprüften Jahresabschluss zu entnehmen.

Gewinn- und Verlustrechnungen

| | 5G Connectivity | Absolute Return Multi Strategy | China A-Share Equity | China Bond | China Equity | Climate Innovation Berichtszeitraum | CLO Income | Commodities | |
|--|------------------------|--------------------------------|----------------------|-------------------|-------------------|-------------------------------------|-------------------|-------------------|-------------|
| | Geschäftsjahr zum | Geschäftsjahr zum | Geschäftsjahr zum | Geschäftsjahr zum | Geschäftsjahr zum | Berichtszeitraum zum | Geschäftsjahr zum | Geschäftsjahr zum | |
| | Anm. 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2023* | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2023** | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2023 | |
| | US\$ | US\$ | CNY | CNY | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | |
| Erträge | | | | | | | | | |
| Zinserträge | 1 | 1.613.265 | 4.700 | 191 | 14.012.501 | 118.367 | 2.722 | 16.251.994 | 3.172.776 |
| Dividendenerträge | 1 | 5.844.061 | 12.860 | 330.323 | – | 5.998.152 | 7.825 | 488.555 | – |
| Sonstige Erträge | | – | 1.832 | – | – | 261 | – | – | – |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten | 11 | 342.688.178 | (19.392) | (2.078.125) | 24.887.406 | (65.385.007) | (83.333) | 15.296.714 | (9.444.949) |
| | | 350.145.504 | – | (1.747.611) | 38.899.907 | (59.268.227) | (72.786) | 32.037.263 | (6.272.173) |
| Aufwendungen | | | | | | | | | |
| Managementgebühr | 6 | 14.117.852 | – | 141.677 | 255.294 | 3.175.628 | 112 | 872.722 | 438.730 |
| Vertriebsgebühren | 6 | 647.325 | – | – | – | 183 | – | – | 2.462 |
| Verwaltungsgebühren | 6 | 591.471 | – | 284.983 | 564.899 | 165.356 | 12.359 | 111.751 | 99.444 |
| Bereitstellungsprovision | 19 | 187.549 | – | 2.284 | 49.489 | 38.821 | 93 | 20.130 | 15.833 |
| Depotgebühren | 6 | 132.274 | – | 85.543 | 247.855 | 61.993 | 2.503 | 12.061 | 12.000 |
| Gebühren der Verwahrstelle | 6 | 60.619 | – | 898 | 26.749 | 15.891 | 29 | 8.035 | 6.800 |
| Honorare | 9 | 239.594 | – | 373.292 | 551.080 | 137.367 | 12.320 | 77.913 | 59.473 |
| Honorare der Direktoren | 7 | 4.813 | – | 31.072 | 30.759 | 4.351 | 1.375 | 4.436 | 4.416 |
| Transaktionskosten | 9 | 2.027.737 | – | 182.302 | 104.430 | 473.178 | 13.023 | 38.730 | 40.645 |
| Gründungsaufwendungen | 9 | – | – | – | – | – | 32.730 | – | – |
| Prüfungshonorare | 8 | 12.024 | – | 74.507 | 75.617 | 10.793 | 10.779 | 10.872 | 10.688 |
| Umsatzsteuerentlastung | | (6.953) | – | (111) | (4.238) | (1.811) | (1) | (1.085) | (871) |
| Sonstige Aufwendungen | 9 | 29.234 | – | 63.082 | 181.289 | 18.825 | 327 | 8.112 | 12.060 |
| Kostenverzicht | 6 | – | – | (1.006.693) | (722.214) | – | (52.175) | – | (37.378) |
| Aufwendungen insgesamt | | 18.043.539 | – | 232.836 | 1.361.009 | 4.100.575 | 33.474 | 1.163.677 | 664.302 |
| Finanzierungskosten | | | | | | | | | |
| Zinsaufwendungen | | 641 | – | – | 8.419 | – | – | – | – |
| Gezahlte Ausschüttungen | 1 | – | – | 15.082 | 222.140 | 3.216 | – | 9.174.149 | – |
| | | 641 | – | 15.082 | 230.559 | 3.216 | – | 9.174.149 | – |
| Quellensteuern | 1 | 1.253.704 | – | 32.397 | 19.376 | 413.387 | 1.185 | – | – |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit | | 330.847.620 | – | (2.027.926) | 37.288.963 | (63.785.405) | (107.445) | 21.699.437 | (6.936.475) |

* Der Absolute Return Multi Strategy wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

** Der Climate Innovation wurde am 1. August 2023 aufgelegt.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

| | Anm. | Corporate Hybrid Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 EUR | Developed Market FMP – 2027 Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023* US\$ | Emerging Market Debt - Hard Currency Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US\$ | Emerging Market Debt - Local Currency Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US\$ | Emerging Market Debt Blend Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US\$ | Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US\$ | Emerging Markets Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US\$ | Emerging Markets Select Equity Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023** US\$ |
|--|------|---|--|--|---|--|--|--|---|
| Erträge | | | | | | | | | |
| Zinserträge | 1 | 78.046.057 | 2.080.257 | 142.794.885 | 74.404.513 | 26.990.410 | 2.739.189 | 199.109 | 168.843 |
| Dividendenerträge | 1 | – | – | – | 113.951 | 171.675 | – | 2.885.513 | 1.307.641 |
| Sonstige Erträge | | – | – | – | 1.161.393 | 310.983 | 7.843 | 131 | 4.097 |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten | 11 | 76.398.634 | 3.758.602 | 211.428.520 | 98.021.149 | 36.380.307 | 1.250.394 | 9.999.988 | 2.658.863 |
| | | 154.444.691 | 5.838.859 | 354.223.405 | 173.701.006 | 63.853.375 | 3.997.426 | 13.084.741 | 4.139.444 |
| Aufwendungen | | | | | | | | | |
| Managementgebühr | 6 | 11.575.142 | 276.626 | 18.716.353 | 8.682.808 | 3.275.391 | 288.809 | 1.251.833 | 506.150 |
| Vertriebsgebühren | 6 | 188.575 | – | 257.674 | 211.184 | 27.982 | – | 38.630 | – |
| Verwaltungsgebühren | 6 | 786.884 | 25.844 | 1.322.602 | 776.349 | 390.982 | 115.789 | 194.084 | 62.348 |
| Bereitstellungsprovision | 19 | 255.784 | 4.051 | 359.881 | 182.049 | 70.533 | 8.546 | 23.159 | 11.942 |
| Depotgebühren | 6 | 120.929 | 2.686 | 187.281 | 821.231 | 166.826 | 14.472 | 62.279 | 42.088 |
| Gebühren der Verwahrstelle | 6 | 84.817 | 1.200 | 121.595 | 46.840 | 30.217 | 3.067 | 8.287 | 3.520 |
| Honorare | 9 | 299.200 | 12.476 | 429.692 | 320.609 | 168.668 | 39.476 | 170.898 | 63.180 |
| Honorare der Direktoren | 7 | 3.805 | 1.375 | 4.350 | 4.345 | 4.615 | 4.346 | 4.351 | 3.502 |
| Transaktionskosten | 9 | 85.505 | 876 | 355.940 | 456.525 | 258.261 | 80.894 | 860.872 | 408.555 |
| Gründungs aufwendungen | 9 | – | 31.982 | – | – | – | – | – | – |
| Prüfungshonorare | 8 | 10.993 | 10.960 | 12.130 | 12.363 | 12.240 | 10.239 | 10.756 | 11.886 |
| Umsatzsteuerentlastung | | (15.890) | (62) | (23.123) | (11.635) | (4.408) | (503) | (1.214) | (472) |
| Sonstige Aufwendungen | 9 | 8.913 | 327 | 10.300 | 25.954 | 22.095 | 8.703 | 11.602 | 9.105 |
| Kostenverzicht | 6 | – | (151) | – | (107.151) | (7.876) | (150.355) | (246.700) | (75.080) |
| Aufwendungen insgesamt | | 13.404.657 | 368.190 | 21.754.675 | 11.421.471 | 4.415.526 | 423.483 | 2.388.837 | 1.046.724 |
| Finanzierungskosten | | | | | | | | | |
| Zinsaufwendungen | | 136.189 | 225 | 807 | 38.492 | 9.326 | 4.222 | 1.315 | – |
| Gezahlte Ausschüttungen | 1 | 15.938.833 | – | 34.774.185 | 19.776.443 | 5.146.481 | – | 211.792 | – |
| | | 16.075.022 | 225 | 34.774.992 | 19.814.935 | 5.155.807 | 4.222 | 213.107 | – |
| Quellensteuern | 1 | – | 13.414 | 2.125 | 561.616 | 98.515 | 25.749 | 317.037 | 176.255 |
| Kapitalertragsteuer | 1 | – | – | – | 190.222 | 5.295 | 5.491 | 602.394 | 153.572 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit | | 124.965.012 | 5.457.030 | 297.691.613 | 141.712.762 | 54.178.232 | 3.538.481 | 9.563.366 | 2.762.893 |

* Der Developed Market FMP – 2027 wurde am 31. Juli 2023 aufgelegt.

** Der Emerging Markets Select Equity wurde am 7. September 2023 aufgelöst.

Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

| | | Euro Bond Geschäftsjahr zum Anm. 31. Dezember 2023 EUR | Euro Bond Absolute Return Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 EUR | European High Yield Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 EUR | European Sustainable Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 EUR | Event Driven Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US\$ | Global Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US\$ | Global Diversified Income FMP – 2024 Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US\$ | Global Equity Megatrends Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US\$ |
|--|----|---|---|--|---|--|---|--|---|
| Erträge | | | | | | | | | |
| Zinserträge | 1 | 299.445 | 1.325.303 | 6.144.081 | 46.810 | 531.326 | 4.814.163 | 6.583.236 | 66.717 |
| Dividendenerträge | 1 | – | – | – | 2.466.485 | – | – | – | 1.360.692 |
| Sonstige Erträge | | 3.353 | 9.632 | – | – | – | 6.489 | – | 6.969 |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten | 11 | 703.906 | 1.706.179 | 17.258.206 | 29.777.265 | 9.605.231 | 2.834.548 | 3.455.573 | 20.285.551 |
| | | 1.006.704 | 3.041.114 | 23.402.287 | 32.290.560 | 10.136.557 | 7.655.200 | 10.038.809 | 21.719.929 |
| Aufwendungen | | | | | | | | | |
| Managementgebühr | 6 | 34.123 | 41.625 | 192.591 | 518.724 | 419.803 | 10.546 | 897.634 | 1.330.600 |
| Vertriebsgebühren | 6 | – | – | 4.027 | 341 | – | 5.754 | – | 259.499 |
| Verwaltungsgebühren | 6 | 57.348 | 74.539 | 138.341 | 108.783 | 70.949 | 173.685 | 107.262 | 121.770 |
| Bereitstellungsprovision | 19 | 1.380 | 6.436 | 11.429 | 23.096 | 9.340 | 19.346 | 22.929 | 14.348 |
| Depotgebühren | 6 | 11.095 | 10.943 | 10.994 | 20.847 | 10.672 | 12.232 | 12.000 | 12.097 |
| Gebühren der Verwahrstelle | 6 | 551 | 2.475 | 5.939 | 9.116 | 2.953 | 7.665 | 9.030 | 5.585 |
| Honorare | 9 | 30.275 | 36.460 | 81.370 | 65.478 | 93.976 | 70.705 | 80.075 | 66.380 |
| Honorare der Direktoren | 7 | 4.346 | 4.349 | 3.759 | 3.967 | 3.597 | 4.351 | 4.378 | 4.359 |
| Erfolgsabhängige Gebühr | 6 | – | – | – | – | 1.269.230 | – | – | – |
| Transaktionskosten | 9 | 13.533 | 31.654 | 26.386 | 151.518 | 25.962 | 94.888 | 4.942 | 64.743 |
| Prüfungshonorare | 8 | 8.724 | 9.033 | 10.491 | 9.604 | 11.071 | 10.000 | 10.890 | 10.442 |
| Umsatzsteuerentlastung | | (89) | (397) | (746) | (1.330) | (695) | (1.185) | (1.109) | (768) |
| Sonstige Aufwendungen | 9 | 9.077 | 9.077 | 11.095 | 8.742 | – | 9.560 | 6.978 | 21.064 |
| Kostenverzicht | 6 | (113.220) | (84.716) | (49.387) | – | (80.167) | (99.791) | – | (2) |
| Aufwendungen insgesamt | | 57.143 | 141.478 | 446.289 | 918.886 | 1.836.691 | 317.756 | 1.155.009 | 1.910.117 |
| Finanzierungskosten | | | | | | | | | |
| Zinsaufwendungen | | 49 | 2.740 | 336 | 58 | 160 | 373 | – | 1.660 |
| Gezahlte Ausschüttungen | 1 | 198.317 | 160 | 57.021 | 1.048.292 | – | 2.390 | 3.747.714 | – |
| | | 198.366 | 2.900 | 57.357 | 1.048.350 | 160 | 2.763 | 3.747.714 | 1.660 |
| Quellensteuern | 1 | – | – | 24.070 | 386.738 | 4.281 | 46.961 | 738 | 207.790 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit | | 751.195 | 2.896.736 | 22.874.571 | 29.936.586 | 8.295.425 | 7.287.720 | 5.135.348 | 19.600.362 |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

| | | Global Flexible Credit Income | Global High Yield SDG Engagement | Global High Yield Sustainable Action Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023* | Global Investment Grade Credit | Global Opportunistic Bond | Global Real Estate Securities | Global Sustainable Equity | Global Sustainable Value |
|--|------|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Anm. | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US\$ | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US\$ | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023* US\$ | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US\$ | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US\$ | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US\$ | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US\$ | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US\$ |
| Erträge | | | | | | | | | |
| Zinserträge | 1 | 21.820.785 | 30.627.441 | 381.879 | 3.526.734 | 2.880.171 | 39.396 | 58.764 | 13.338 |
| Dividendenerträge | 1 | 21.240 | – | – | – | 6.726 | 1.264.200 | 1.296.585 | 1.502.022 |
| Sonstige Erträge | | 84.242 | 38.129 | – | – | 46.306 | – | – | 4.516 |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten | 11 | 35.644.061 | 26.225.288 | 301.287 | 4.608.966 | 1.814.974 | 305.309 | 30.786.664 | 6.863.427 |
| | | 57.570.328 | 56.890.858 | 683.166 | 8.135.700 | 4.748.177 | 1.608.905 | 32.142.013 | 8.383.303 |
| Aufwendungen | | | | | | | | | |
| Managementgebühr | 6 | 1.581.714 | 1.820.214 | 36.223 | 45.379 | 107.580 | 223.249 | 385.849 | 120.957 |
| Vertriebsgebühren | 6 | 48.797 | 7.284 | – | – | – | 18.013 | 3.636 | 4.224 |
| Verwaltungsgebühren | 6 | 203.139 | 338.869 | 70.047 | 105.600 | 160.902 | 81.792 | 110.846 | 79.855 |
| Bereitstellungsprovision | 19 | 50.956 | 69.680 | 1.194 | 13.918 | 9.516 | 4.522 | 18.864 | 5.675 |
| Depotgebühren | 6 | 12.177 | 16.554 | 6.000 | 11.989 | 12.081 | 12.000 | 12.000 | 11.965 |
| Gebühren der Verwahrstelle | 6 | 20.039 | 26.984 | 462 | 6.727 | 3.502 | 1.742 | 7.898 | 2.558 |
| Honorare | 9 | 81.067 | 133.872 | 38.938 | 4.017 | 57.834 | 71.086 | 70.149 | 64.011 |
| Honorare der Direktoren | 7 | 4.358 | 4.347 | 2.387 | 4.075 | 4.352 | 4.545 | 4.378 | 4.546 |
| Transaktionskosten | 9 | 73.004 | 133.254 | 2.818 | 5.693 | 81.558 | 90.308 | 42.340 | 116.303 |
| Prüfungshonorare | 8 | 17.347 | 11.736 | 10.617 | 10.304 | 10.636 | 10.663 | 10.686 | 10.598 |
| Umsatzsteuerentlastung | | (2.430) | (4.135) | (44) | (625) | (641) | (313) | (1.027) | (429) |
| Sonstige Aufwendungen | 9 | 10.197 | 10.004 | 5.115 | 8.276 | 9.387 | 9.598 | 12.831 | 9.043 |
| Kostenverzicht | 6 | – | (159.267) | (122.957) | (43.306) | (181.897) | (134.867) | – | (84.092) |
| Verzicht auf Gebühren | 6 | (1.719) | – | – | – | (544) | – | – | – |
| Aufwendungen insgesamt | | 2.098.646 | 2.409.396 | 50.800 | 172.047 | 274.266 | 392.338 | 678.450 | 345.214 |
| Finanzierungskosten | | | | | | | | | |
| Zinsaufwendungen | | 471 | 6 | 29 | 101 | 346 | 182 | 909 | 211 |
| Gezahlte Ausschüttungen | 1 | 18.040 | 364.914 | 289.047 | – | 309.334 | 290.893 | – | – |
| | | 18.511 | 364.920 | 289.076 | 101 | 309.680 | 291.075 | 909 | 211 |
| Quellensteuern | 1 | 72.578 | – | – | 7.061 | 5.267 | 253.104 | 335.347 | 300.594 |
| Kapitalertragsteuer | 1 | – | – | – | – | – | – | – | 1.449 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit | | 55.380.593 | 54.116.542 | 343.290 | 7.956.491 | 4.158.964 | 672.388 | 31.127.307 | 7.735.835 |

* Der Global High Yield Sustainable Action wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

| | | High Yield Bond | InnovAsia 5G | Japan Equity Engagement | Macro Opportunities FX | Multi-Asset Income | Next Generation Mobility | Next Generation Space Economy | Responsible Asian Debt - Hard Currency | |
|--|------|---|---|--|--|---|---|---|---|--|
| | Anm. | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US\$ | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US\$ | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 JPY | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 EUR | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023* US\$ | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US\$ | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US\$ | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US\$ | |
| Erträge | | | | | | | | | | |
| Zinserträge | 1 | 149.097.884 | 35.914 | – | 143.684 | 152.535 | 532.771 | 28.764 | 2.331.729 | |
| Dividendenerträge | 1 | 1.147.749 | 254.715 | 476.921.443 | – | 78.340 | 1.435.123 | 147.664 | 600 | |
| Sonstige Erträge | | 528.115 | – | – | – | 185 | – | – | 1.882 | |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten | 11 | 108.102.355 | 5.319.099 | 4.688.235.837 | (734.342) | 122.062 | 41.427.145 | 3.285.903 | 919.735 | |
| | | 258.876.103 | 5.609.728 | 5.165.157.280 | (590.658) | 353.122 | 43.395.039 | 3.462.331 | 3.253.946 | |
| Aufwendungen | | | | | | | | | | |
| Managementgebühr | 6 | 19.351.744 | 204.049 | 76.940.068 | 119.567 | 67.102 | 2.204.012 | 117.126 | 27.705 | |
| Vertriebsgebühren | 6 | 1.677.140 | 348 | – | – | 16.289 | 365.864 | 21.123 | 3.810 | |
| Verwaltungsgebühren | 6 | 1.505.292 | 74.353 | 15.508.873 | 69.483 | 87.657 | 140.494 | 27.041 | 95.572 | |
| Bereitstellungsprovision | 19 | 316.037 | 2.736 | 3.341.855 | 3.874 | 765 | 23.493 | 1.848 | 6.569 | |
| Depotgebühren | 6 | 30.472 | 12.000 | 2.954.075 | 11.374 | 6.762 | 11.000 | 12.000 | 12.068 | |
| Gebühren der Verwahrstelle | 6 | 126.175 | 1.470 | 1.182.736 | 1.348 | 373 | 7.948 | 335 | 2.701 | |
| Honorare | 9 | 520.499 | 39.126 | 9.102.401 | 39.056 | 56.605 | 91.573 | 30.501 | 129.559 | |
| Honorare der Direktoren | 7 | 4.642 | 3.386 | 618.801 | 4.126 | 2.529 | 4.345 | 4.416 | 4.297 | |
| Transaktionskosten | 9 | 238.123 | 147.113 | 33.260.732 | 52.959 | 49.317 | 44.253 | 23.035 | 12.406 | |
| Prüfungshonorare | 8 | 19.031 | 10.959 | 1.473.796 | 9.246 | 11.336 | 11.031 | 10.191 | 10.696 | |
| Umsatzsteuerentlastung | | (16.779) | (146) | (185.968) | (203) | (70) | (1.398) | (103) | (490) | |
| Sonstige Aufwendungen | 9 | 10.674 | 5.469 | 1.632.029 | 8.734 | 9.625 | 11.418 | 13.171 | 10.364 | |
| Kostenverzicht | 6 | – | (165.298) | – | (147.827) | (209.946) | – | (91.899) | (196.965) | |
| Verzicht auf Gebühren | 6 | (92.880) | – | – | – | – | – | – | – | |
| Aufwendungen insgesamt | | 23.690.170 | 335.565 | 145.829.398 | 171.737 | 98.344 | 2.914.033 | 168.785 | 118.292 | |
| Finanzierungskosten | | | | | | | | | | |
| Zinsaufwendungen | | 602 | 79 | 26.240 | 683 | 4.261 | – | – | 49 | |
| Gezahlte Ausschüttungen | 1 | 90.271.905 | – | 111.381.658 | 5 | 6.037 | – | – | 384.726 | |
| | | 90.272.507 | 79 | 111.407.898 | 688 | 10.298 | – | – | 384.775 | |
| Quellensteuern | 1 | 436.171 | 39.727 | 71.821.634 | – | 7.307 | 277.297 | 23.993 | 51 | |
| Kapitalertragsteuer | 1 | – | (6.993) | – | – | 709 | – | – | – | |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit | | 144.477.255 | 5.241.350 | 4.836.098.350 | (763.083) | 236.464 | 40.203.709 | 3.269.553 | 2.750.828 | |

* Der Multi-Asset Income wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

| | | Short Duration Emerging Market Debt | Short Duration High Yield SDG Engagement | Strategic Income | Sustainable Asia High Yield | Sustainable Emerging Market Corporate Debt | Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency | Tactical Macro Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023* | Ultra Short Term Euro Bond |
|--|------|---|---|---|---|---|---|--|--|
| | Anm. | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US\$ | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US\$ | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US\$ | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US\$ | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US\$ | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US\$ | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023* US\$ | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 EUR |
| Erträge | | | | | | | | | |
| Zinserträge | 1 | 191.792.317 | 42.661.844 | 65.553.584 | 1.607.195 | 4.991.771 | 17.467.146 | 166.723 | 22.390.554 |
| Dividendenerträge | 1 | – | 76.604 | 46.343 | – | 1.800 | – | – | – |
| Sonstige Erträge | | – | 113.328 | 112.776 | – | – | – | 9 | 120.772 |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten | 11 | 165.739.545 | 10.878.844 | 61.142.662 | (630.224) | 4.754.214 | 25.660.200 | 608.249 | 37.931.029 |
| | | 357.531.862 | 53.730.620 | 126.855.365 | 976.971 | 9.747.785 | 43.127.346 | 774.981 | 60.442.355 |
| Aufwendungen | | | | | | | | | |
| Managementgebühr | 6 | 25.136.609 | 4.340.741 | 11.003.160 | 5.539 | 687.958 | 1.328.504 | 128 | 1.387.733 |
| Vertriebsgebühren | 6 | 709.836 | 93.159 | 1.010.946 | – | 29.988 | – | – | 4.291 |
| Verwaltungsgebühren | 6 | 1.974.927 | 451.107 | 1.035.461 | 62.317 | 142.217 | 165.181 | 10.991 | 415.569 |
| Bereitstellungsprovision | 19 | 665.780 | 93.653 | 214.865 | 4.798 | 12.902 | 44.239 | 901 | 122.389 |
| Depotgebühren | 6 | 332.711 | 11.823 | 41.717 | 12.000 | 11.659 | 25.904 | 3.056 | 65.319 |
| Gebühren der Verwahrstelle | 6 | 212.190 | 37.315 | 85.112 | 2.538 | 5.415 | 19.363 | 317 | 47.746 |
| Honorare | 9 | 675.369 | 223.122 | 313.343 | 68.178 | 100.875 | 29.187 | 28.467 | 146.359 |
| Honorare der Direktoren | 7 | 4.793 | 4.351 | 4.334 | 4.416 | 4.351 | 4.416 | 1.849 | 3.874 |
| Transaktionskosten | 9 | 164.417 | 78.566 | 406.719 | 7.339 | 38.710 | 68.273 | 10.264 | 79.640 |
| Gründungsaufwendungen | 9 | – | – | – | – | – | – | 31.982 | – |
| Prüfungshonorare | 8 | 13.674 | 13.597 | – | 10.286 | 12.055 | 10.487 | 9.698 | 9.691 |
| Umsatzsteuerentlastung | | (41.069) | (5.980) | (13.815) | (207) | (876) | (3.062) | (13) | (8.025) |
| Sonstige Aufwendungen | 9 | 11.556 | 8.457 | 7.962 | 13.150 | 9.348 | 8.515 | 2.527 | 8.586 |
| Kostenverzicht | 6 | – | – | – | (138.167) | (168.791) | (3.326) | (42.137) | – |
| Verzicht auf Gebühren | 6 | – | (6.199) | (3.750) | – | – | – | – | – |
| Aufwendungen insgesamt | | 29.860.793 | 5.343.712 | 14.106.054 | 52.187 | 885.811 | 1.697.681 | 58.030 | 2.283.172 |
| Finanzierungskosten | | | | | | | | | |
| Zinsaufwendungen | | 1.763 | – | 2.784 | – | 1.363 | 206 | 532 | – |
| Gezahlte Ausschüttungen | 1 | 51.357.229 | 10.256.963 | 24.092.142 | 375.442 | 203.460 | – | – | 70.519 |
| | | 51.358.992 | 10.256.963 | 24.094.926 | 375.442 | 204.823 | 206 | 532 | 70.519 |
| Quellensteuern | 1 | – | 39.788 | 432.402 | 7.915 | 235 | 253.923 | – | – |
| Kapitalertragsteuer | 1 | – | – | (1.377) | – | – | – | – | – |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit | | 276.312.077 | 38.090.157 | 88.223.360 | 541.427 | 8.656.916 | 41.175.536 | 716.419 | 58.088.664 |

* Der Tactical Macro wurde am 30. Juni 2023 aufgelegt.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

| | | Uncorrelated Strategies | Uncorrelated Trading Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023* | US Equity | US Equity Index PutWrite | US Large Cap Value | US Long Short Equity | US Multi Cap Opportunities | US Real Estate Securities |
|--|--------------------------------|----------------------------|---|---------------------------|-----------------------------|---------------------------|---------------------------|-------------------------------|------------------------------|
| | Geschäftsjahr zum | Geschäftsjahr zum | Geschäftsjahr zum | Geschäftsjahr zum | Geschäftsjahr zum | Geschäftsjahr zum | Geschäftsjahr zum | Geschäftsjahr zum | Geschäftsjahr zum |
| | Anm. 31. Dezember 2023 US\$ | 31. Dezember 2023 US\$ | 31. Dezember 2023 US\$ | 31. Dezember 2023 US\$ | 31. Dezember 2023 US\$ | 31. Dezember 2023 US\$ | 31. Dezember 2023 US\$ | 31. Dezember 2023 US\$ | 31. Dezember 2023 US\$ |
| Erträge | | | | | | | | | |
| Zinserträge | 1 | 39.173.095 | 3.569.936 | 66.021 | 7.387.106 | 3.516.594 | 2.214.827 | 76.721 | 787.359 |
| Dividendenerträge | 1 | – | – | 367.740 | – | 51.415.915 | 2.138.898 | 4.926.517 | 21.216.873 |
| Sonstige Erträge | | – | 8.248 | 91 | – | – | – | 24.292 | – |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten | 11 | (120.381.469) | (12.687.726) | 9.122.314 | 107.636.527 | (71.805.012) | 27.101.438 | 70.024.943 | 40.971.227 |
| | | (81.208.374) | (9.109.542) | 9.556.166 | 115.023.633 | (16.872.503) | 31.455.163 | 75.052.473 | 62.975.459 |
| Aufwendungen | | | | | | | | | |
| Managementgebühr | 6 | 15.768.031 | 2.845.723 | 274.888 | 2.839.436 | 10.553.183 | 2.806.305 | 4.999.948 | 7.539.332 |
| Beratungsgebühren | 6 | 17.684.684 | – | – | – | – | – | – | – |
| Vertriebsgebühren | 6 | 147.327 | – | 15.793 | 11.469 | 271.013 | 33.182 | 427.679 | 1.168.862 |
| Verwaltungsgebühren | 6 | 2.988.157 | 347.786 | 62.733 | 358.913 | 881.818 | 183.718 | 371.095 | 597.879 |
| Bereitstellungsprovision | 19 | 360.886 | 54.101 | 5.066 | 91.827 | 284.218 | 36.599 | 58.199 | 79.342 |
| Depotgebühren | 6 | 269.480 | 62.274 | 11.931 | 12.023 | 28.415 | 12.001 | 11.999 | 11.435 |
| Gebühren der Verwahrstelle | 6 | 245.133 | 45.183 | 1.972 | 32.487 | 110.626 | 8.475 | 23.513 | 27.347 |
| Honorare | 9 | 1.004.200 | 68.646 | 43.779 | 180.390 | 326.808 | 111.907 | 188.172 | 219.239 |
| Honorare der Direktoren | 7 | 4.626 | 2.397 | 4.544 | 4.012 | 4.416 | 4.550 | 4.779 | 4.352 |
| Erfolgsabhängige Gebühr | 6 | – | – | – | – | – | 284.324 | – | – |
| Transaktionskosten | 9 | 15.052.935 | 1.040.744 | 14.565 | 116.951 | 981.117 | 114.629 | 204.132 | 406.687 |
| Prüfungshonorare | 8 | 10.345 | 9.096 | 9.938 | 11.147 | 11.012 | 11.208 | 12.169 | 12.731 |
| Umsatzsteuerentlastung | | (17.461) | (1.707) | (347) | (6.201) | (15.584) | (1.977) | (3.717) | (5.129) |
| Sonstige Aufwendungen | 9 | 5.336.209 | 287.263 | 8.895 | 8.582 | 19.767 | 11.593 | 9.681 | 10.176 |
| Kostenverzicht | 6 | (30.083) | (155.312) | (72.815) | – | – | – | – | – |
| Aufwendungen insgesamt | | 58.824.469 | 4.606.194 | 380.942 | 3.661.036 | 13.456.809 | 3.616.514 | 6.307.649 | 10.072.253 |
| Finanzierungskosten | | | | | | | | | |
| Zinsaufwendungen | | 170.739 | 82.590 | 1.581 | – | – | 3.963 | 1.130 | – |
| Gezahlte Ausschüttungen | 1 | – | – | – | 1.591.989 | 10.005.741 | 206.378 | 12.800 | 4.675.054 |
| | | 170.739 | 82.590 | 1.581 | 1.591.989 | 10.005.741 | 210.341 | 13.930 | 4.675.054 |
| Quellensteuern | 1 | 8.614.771 | 367.188 | 107.017 | – | 14.056.234 | 628.112 | 1.411.773 | 5.817.425 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit | | (148.818.353) | (14.165.514) | 9.066.626 | 109.770.608 | (54.391.287) | 27.000.196 | 67.319.121 | 42.410.727 |

* Der Uncorrelated Trading wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

| | Anm. | US Small Cap Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US\$ | US Small Cap Intrinsic Value Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US\$ | Fonds insgesamt* Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US\$ |
|--|------|---|--|---|
| Erträge | | | | |
| Zinserträge | 1 | 507.554 | 977.188 | 995.771.322 |
| Dividenderträge | 1 | 6.044.808 | 1.760.459 | 119.445.636 |
| Sonstige Erträge | | 43.524 | – | 2.650.276 |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten | 11 | 86.161.892 | 34.297.130 | 1.584.823.295 |
| | | 92.757.778 | 37.034.777 | 2.702.690.529 |
| Aufwendungen | | | | |
| Managementgebühr | 6 | 5.957.709 | 2.190.026 | 194.432.180 |
| Beratungsgebühren | 6 | – | – | 17.684.684 |
| Vertriebsgebühren | 6 | 191.973 | 4.501 | 7.946.225 |
| Verwaltungsgebühren | 6 | 406.184 | 180.153 | 19.659.563 |
| Bereitstellungsprovision | 19 | 90.926 | 36.673 | 4.139.264 |
| Depotgebühren | 6 | 11.971 | 11.950 | 2.966.123 |
| Gebühren der Verwahrstelle | 6 | 27.463 | 14.201 | 1.615.560 |
| Honorare | 9 | 215.352 | 96.440 | 8.275.274 |
| Honorare der Direktoren | 7 | 4.351 | 4.416 | 234.165 |
| Erfolgsabhängige Gebühr | 6 | – | – | 1.553.554 |
| Transaktionskosten | 9 | 239.541 | 99.564 | 26.064.424 |
| Gründungs aufwendungen | 9 | – | – | 96.694 |
| Prüfungshonorare | 8 | 11.044 | 10.448 | 627.861 |
| Umsatzsteuerentlastung | | (5.515) | (2.289) | (240.259) |
| Sonstige Aufwendungen | 9 | 12.865 | 20.882 | 6.232.386 |
| Kostenverzicht | 6 | – | – | (3.529.280) |
| Verzicht auf Gebühren | 6 | – | – | (105.092) |
| Aufwendungen insgesamt | | 7.163.864 | 2.666.965 | 287.653.326 |
| Finanzierungskosten | | | | |
| Zinsaufwendungen | | 1.960 | – | 485.899 |
| Gezahlte Ausschüttungen | 1 | – | – | 287.094.911 |
| | | 1.960 | – | 287.580.810 |
| Quellensteuern | 1 | 1.757.033 | 458.379 | 39.795.504 |
| Kapitalertragsteuer | 1 | – | – | 950.762 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit | | 83.834.921 | 33.909.433 | 2.086.710.127 |

Alle Erträge und Aufwendungen ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit – mit Ausnahme des Absolute Return Multi Strategy, Emerging Markets Select Equity, Global High Yield Sustainable Action, Multi-Asset Income, Uncorrelated Trading und Macro Opportunities FX, die am 20. Dezember 2021, 7. September 2023, 16. Juni 2023, 6. Juli 2023, 24. Mai 2023 bzw. 8. Februar 2024 aufgelöst wurden. Außer den in der konsolidierten Gewinn- und Verlustrechnung ausgewiesenen gab es keine Gewinne und Verluste im Geschäftsjahr.

* Der konsolidierte Jahresabschluss wurde um Überkreuzinvestitionen zwischen den Portfolios bereinigt. Details zu Überkreuzinvestitionen zwischen Portfolios sind Anmerkung 10 der Anmerkungen zum geprüften Jahresabschluss zu entnehmen.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

| | | 5G Connectivity | Absolute Return Multi Strategy | China A-Share Equity | China Bond | China Equity | CLO Income | Commodities Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022** | Corporate Hybrid Bond |
|--|------|---|--|--|--|---|---|--|--|
| | Anm. | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$ | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022* US\$ | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 CNY | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 CNY | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$ | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$ | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022** US\$ | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 EUR |
| Erträge | | | | | | | | | |
| Zinserträge | 1 | 508.120 | 5.657 | 5 | 17.550.832 | 30.119 | 11.114.425 | 761.052 | 79.295.541 |
| Dividenderträge | 1 | 7.178.948 | 4.375 | 292.013 | – | 10.269.050 | – | – | – |
| Erträge aus der Wertpapierleihe | 18 | – | – | – | – | – | – | – | 58.183 |
| Sonstige Erträge | | – | 11.709 | – | 181.398 | – | – | – | – |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten | 11 | (941.839.697) | (20.585) | (5.711.132) | (22.887.822) | (118.823.844) | (27.050.224) | (2.014.541) | (361.963.166) |
| | | (934.152.629) | 1.156 | (5.419.114) | (5.155.592) | (108.524.675) | (15.935.799) | (1.253.489) | (282.609.442) |
| Aufwendungen | | | | | | | | | |
| Managementgebühr | 6 | 19.318.527 | – | 178.248 | 933.339 | 4.936.192 | 754.722 | 215.308 | 13.032.178 |
| Vertriebsgebühren | 6 | 712.648 | – | – | – | 245.552 | – | 1.855 | 234.871 |
| Verwaltungsgebühren | 6 | 886.958 | – | 184.996 | 507.602 | 212.517 | 90.685 | 56.244 | 938.540 |
| Bereitstellungsprovision | 19 | 31.352 | – | 2.947 | 147.157 | 57.652 | 18.464 | 1.214 | 280.396 |
| Depotgebühren | 6 | 178.402 | – | 60.522 | 348.069 | 96.429 | 11.978 | 10.714 | 146.044 |
| Gebühren der Verwahrstelle | 6 | 69.708 | – | 990 | 26.990 | 19.916 | 6.763 | 1.977 | 100.979 |
| Honorare | 9 | 231.415 | – | 410.382 | 425.712 | 85.740 | 34.913 | 78.404 | 177.179 |
| Honorare der Direktoren | 7 | 4.413 | – | 26.679 | 25.027 | 6.008 | 4.413 | 4.511 | 4.290 |
| Transaktionskosten | 9 | 4.063.843 | – | 78.836 | 383.773 | 614.068 | 9.785 | 5.685 | 92.938 |
| Gründungs aufwendungen | 9 | – | – | – | – | – | 852 | 33.630 | – |
| Prüfungshonorare | 8 | 5.197 | – | 50.136 | – | 4.500 | 6.049 | 9.775 | 5.637 |
| Umsatzsteuerentlastung | | (9.178) | (6) | (130) | (2.854) | (2.644) | (860) | (337) | (9.907) |
| Sonstige Aufwendungen | 9 | 38.111 | 315 | 59.626 | 43.742 | 19.417 | 5 | 4.607 | 7.354 |
| Kostenverzicht | 6 | – | – | (837.096) | (411.916) | – | – | (68.886) | – |
| Aufwendungen insgesamt | | 25.531.396 | 309 | 216.136 | 2.426.641 | 6.295.347 | 937.769 | 354.701 | 15.010.499 |
| Finanzierungskosten | | | | | | | | | |
| Zinsaufwendungen | | 6.766 | 27 | – | 92 | – | 77 | 3.364 | 90 |
| Gezahlte Ausschüttungen | 1 | – | – | – | 1.637.507 | 3.567 | 7.260.183 | – | 14.808.934 |
| | | 6.766 | 27 | – | 1.637.599 | 3.567 | 7.260.260 | 3.364 | 14.809.024 |
| Quellensteuern | 1 | 1.353.511 | 820 | 28.972 | 1.191 | 644.858 | – | – | – |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit | | (961.044.302) | – | (5.664.222) | (9.221.023) | (115.468.447) | (24.133.828) | (1.611.554) | (312.428.965) |

* Der Absolute Return Multi Strategy wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

** Der Commodities wurde am 9. Februar 2022 aufgelegt.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

| | Anm. | Emerging Market Debt - Hard Currency Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$ | Emerging Market Debt - Local Currency Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$ | Emerging Market Debt Blend Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$ | Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$ | Emerging Markets Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$ | Emerging Markets Select Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$ | Euro Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 EUR | Euro Bond Absolute Return Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 EUR |
|--|------|---|--|--|---|---|--|---|--|
| Erträge | | | | | | | | | |
| Zinserträge | 1 | 161.758.842 | 94.893.060 | 38.711.817 | 1.731.498 | 113.992 | 44.263 | 291.490 | 1.478.485 |
| Dividenderträge | 1 | – | – | – | – | 6.665.213 | 1.781.971 | – | – |
| Erträge aus der Wertpapierleihe | 18 | 4.832 | – | 225 | – | 3.729 | 7.254 | – | 1.599 |
| Sonstige Erträge | | 1.169 | 1.378.016 | 223.635 | 5.772 | – | – | 15.109 | 774 |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten | 11 | (907.566.216) | (362.048.632) | (194.294.151) | (10.289.442) | (104.550.163) | (31.139.498) | (1.973.354) | (2.689.235) |
| | | (745.801.373) | (265.777.556) | (155.358.474) | (8.552.172) | (97.767.229) | (29.306.010) | (1.666.755) | (1.208.377) |
| Aufwendungen | | | | | | | | | |
| Managementgebühr | 6 | 20.247.383 | 11.488.267 | 4.507.415 | 213.980 | 3.549.106 | 848.534 | 35.202 | 129.504 |
| Vertriebsgebühren | 6 | 283.501 | 488.229 | 28.973 | – | 633.038 | – | – | – |
| Verwaltungsgebühren | 6 | 1.498.184 | 993.867 | 507.693 | 94.007 | 269.047 | 65.031 | 47.375 | 75.304 |
| Bereitstellungsprovision | 19 | 404.319 | 234.390 | 88.155 | 5.838 | 37.131 | 13.636 | 1.393 | 7.513 |
| Depotgebühren | 6 | 182.518 | 994.955 | 215.807 | 11.978 | 158.696 | 57.652 | 11.642 | 11.642 |
| Gebühren der Verwahrstelle | 6 | 132.993 | 81.447 | 32.932 | 2.138 | 14.844 | 4.995 | 503 | 2.696 |
| Honorare | 9 | 264.145 | 214.230 | 115.727 | 49.205 | 157.724 | 74.598 | 42.648 | 45.713 |
| Honorare der Direktoren | 7 | 6.008 | 5.708 | 4.408 | 6.013 | 6.008 | 6.013 | 4.290 | 4.289 |
| Transaktionskosten | 9 | 283.413 | 821.821 | 321.071 | 67.397 | 821.150 | 220.689 | 12.629 | 30.251 |
| Prüfungshonorare | 8 | – | – | 5.551 | 10.090 | 1.352 | 7.475 | 5.419 | 4.796 |
| Umsatzsteuerentlastung | | (12.788) | (7.942) | (3.297) | (250) | (1.488) | (470) | (48) | (260) |
| Sonstige Aufwendungen | 9 | 21.140 | 7.379 | 12.886 | 28.191 | 25.030 | 12.433 | 7.283 | 17.286 |
| Kostenverzicht | 6 | – | (73.477) | – | (179.530) | – | – | (97.305) | (75.384) |
| Aufwendungen insgesamt | | 23.310.816 | 15.248.874 | 5.837.321 | 309.057 | 5.671.638 | 1.310.586 | 71.031 | 253.350 |
| Finanzierungskosten | | | | | | | | | |
| Zinsaufwendungen | | 5.356 | 21.844 | 14.000 | 147 | 1.954 | 235 | 186 | 933 |
| Gezahlte Ausschüttungen | 1 | 40.376.295 | 27.734.955 | 6.413.111 | – | 2.683 | 391 | 228.600 | 273.051 |
| | | 40.381.651 | 27.756.799 | 6.427.111 | 147 | 4.637 | 626 | 228.786 | 273.984 |
| Quellensteuern | 1 | 194 | 2.910.677 | 619.394 | 35.333 | 741.654 | 254.565 | 22 | 339 |
| Kapitalertragsteuer | 1 | – | (1.700.716) | (253.248) | (892) | 288.157 | 59.418 | – | – |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit | | (809.494.034) | (309.993.190) | (167.989.052) | (8.895.817) | (104.473.315) | (30.931.205) | (1.966.594) | (1.736.050) |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

| | | European High Yield Bond | European Sustainable Equity | Event Driven Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022* | Global Bond | Global Diversified Income FMP – 2024 | Global Equity Megatrends | Global Flexible Credit Income | Global High Yield SDG Engagement |
|--|------|--|--|--|---|---|---|---|---|
| | Anm. | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 EUR | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 EUR | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022* US\$ | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$ | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$ | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$ | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$ | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$ |
| Erträge | | | | | | | | | |
| Zinserträge | 1 | 1.579.480 | 285 | 46.006 | 3.672.397 | 9.413.111 | 6.923 | 31.152.028 | 9.427.806 |
| Dividendenerträge | 1 | – | 2.232.834 | – | – | – | 871.691 | 27.852 | – |
| Erträge aus der Wertpapierleihe | 18 | 977 | – | – | 1 | – | – | – | 64 |
| Sonstige Erträge | | – | – | – | 64 | – | 41.273 | 575.391 | 146.217 |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten | 11 | (2.325.679) | (34.675.503) | 1.508.010 | (29.797.838) | (18.259.895) | (11.756.473) | (153.936.569) | (28.263.433) |
| | | (745.222) | (32.442.384) | 1.554.016 | (26.125.376) | (8.846.784) | (10.836.586) | (122.181.298) | (18.689.346) |
| Aufwendungen | | | | | | | | | |
| Managementgebühr | 6 | 123.290 | 703.244 | 45.155 | 10.726 | 1.127.870 | 1.156.284 | 2.181.890 | 538.649 |
| Vertriebsgebühren | 6 | 2.676 | 246 | – | 6.835 | – | 231.163 | 52.452 | 9.621 |
| Verwaltungsgebühren | 6 | 98.701 | 92.580 | 6.126 | 158.041 | 119.720 | 146.949 | 296.237 | 170.523 |
| Bereitstellungsprovision | 19 | 4.866 | 18.552 | – | 19.323 | 29.244 | 10.953 | 81.408 | 17.656 |
| Depotgebühren | 6 | 12.142 | 16.501 | 1.088 | 11.978 | 12.000 | 11.978 | 19.553 | 11.978 |
| Gebühren der Verwahrstelle | 6 | 1.766 | 7.448 | 180 | 7.385 | 10.580 | 3.997 | 27.943 | 8.288 |
| Honorare | 9 | 54.516 | 51.880 | 10.026 | 65.013 | 68.920 | 13.585 | 66.596 | 77.026 |
| Honorare der Direktoren | 7 | 4.290 | 4.290 | 756 | 6.008 | 4.413 | 6.013 | 5.108 | 4.608 |
| Erfolgsabhängige Gebühr | 6 | – | – | 89.185 | – | – | – | – | – |
| Transaktionskosten | 9 | 20.917 | 272.168 | 1.300 | 60.787 | 5.996 | 52.011 | 54.664 | 58.010 |
| Gründungs aufwendungen | 9 | – | – | 41.146 | – | – | – | – | – |
| Prüfungshonorare | 8 | 4.766 | 4.102 | 9.261 | 6.103 | 5.474 | 5.975 | 5.755 | 6.692 |
| Umsatzsteuerentlastung | | (164) | (833) | – | (717) | (1.304) | (471) | (3.680) | (355) |
| Sonstige Aufwendungen | 9 | 7.237 | 14.409 | 1.019 | 6.134 | 7.137 | 16.621 | 8.902 | 9.459 |
| Kostenverzicht | 6 | (133.519) | (2.297) | (18.805) | (15.740) | – | – | – | (170.483) |
| Verzicht auf Gebühren | 6 | – | – | – | – | – | – | (3.232) | – |
| Aufwendungen insgesamt | | 201.484 | 1.182.290 | 186.437 | 341.876 | 1.390.050 | 1.655.058 | 2.793.596 | 741.672 |
| Finanzierungskosten | | | | | | | | | |
| Zinsaufwendungen | | – | 1.299 | 4 | 1.712 | – | 357 | 9.004 | 5 |
| Gezahlte Ausschüttungen | 1 | 42.280 | 102.238 | – | 2.670 | 6.122.730 | – | 17.376 | 199.127 |
| | | 42.280 | 103.537 | 4 | 4.382 | 6.122.730 | 357 | 26.380 | 199.132 |
| Quellensteuern | 1 | – | 259.294 | – | 11.787 | – | 132.826 | 404.810 | – |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit | | (988.986) | (33.987.505) | 1.367.575 | (26.483.421) | (16.359.564) | (12.624.827) | (125.406.084) | (19.630.150) |

* Der Event Driven wurde am 26. Oktober 2022 aufgelegt.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

| | | Global High Yield Sustainable Action Geschäftsjahr zum Anm. 31. Dezember 2022 US\$ | Global Investment Grade Credit Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$ | Global Opportunistic Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$ | Global Real Estate Securities Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$ | Global Sustainable Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$ | Global Sustainable Value Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$ | High Yield Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$ | InnovAsia 5G Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$ |
|--|----|--|---|---|--|--|---|---|--|
| Erträge | | | | | | | | | |
| Zinserträge | 1 | 795.609 | 2.806.792 | 2.954.283 | 9.224 | 24.531 | 7.219 | 148.199.441 | 9.677 |
| Dividendenerträge | 1 | – | – | 146.100 | 1.602.477 | 1.528.140 | 1.514.896 | 1.708.574 | 298.196 |
| Erträge aus der Wertpapierleihe | 18 | – | – | 142 | – | – | 410 | 369.752 | – |
| Sonstige Erträge | | – | – | 6 | – | – | 485 | 1.121.365 | – |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten | 11 | (2.685.869) | (16.760.362) | (13.983.992) | (16.363.551) | (68.012.895) | (5.399.900) | (500.609.800) | (11.968.585) |
| | | (1.890.260) | (13.953.570) | (10.883.461) | (14.751.850) | (66.460.224) | (3.876.890) | (349.210.668) | (11.660.712) |
| Aufwendungen | | | | | | | | | |
| Managementgebühr | 6 | 81.903 | 45.058 | 169.512 | 321.261 | 776.253 | 117.742 | 22.808.364 | 190.730 |
| Vertriebsgebühren | 6 | – | – | 2.561 | 24.343 | 63.178 | 4.586 | 2.403.333 | 261 |
| Verwaltungsgebühren | 6 | 66.803 | 75.396 | 153.587 | 78.512 | 112.556 | 67.551 | 1.707.662 | 58.185 |
| Bereitstellungsprovision | 19 | 2.185 | 1.339 | 12.291 | 7.270 | 28.977 | 7.706 | 368.659 | 3.217 |
| Depotgebühren | 6 | 12.000 | 14.000 | 11.978 | 12.000 | 12.000 | 12.978 | 32.781 | 12.993 |
| Gebühren der Verwahrstelle | 6 | 782 | 2.734 | 4.127 | 2.329 | 9.493 | 2.335 | 124.075 | 506 |
| Honorare | 9 | 36.984 | 68.532 | 51.748 | 63.979 | 54.659 | 100.404 | 281.572 | 105.017 |
| Honorare der Direktoren | 7 | 4.408 | 4.230 | 4.608 | 4.408 | 4.408 | 4.408 | 4.413 | 5.344 |
| Transaktionskosten | 9 | 4.102 | 1.543 | 70.999 | 127.175 | 126.209 | 186.029 | 280.642 | 203.216 |
| Prüfungshonorare | 8 | 6.414 | 15.088 | 8.086 | 7.164 | 6.110 | 6.053 | 688 | 13.494 |
| Umsatzsteuerentlastung | | (66) | (542) | (407) | (245) | (1.256) | (208) | (15.511) | (131) |
| Sonstige Aufwendungen | 9 | 7.671 | 4.816 | 28.964 | 10.704 | 614 | 6.957 | 10.586 | 7.975 |
| Kostenverzicht | 6 | (108.883) | (73.986) | (136.859) | (89.942) | – | (134.803) | – | (243.487) |
| Verzicht auf Gebühren | 6 | – | – | (1.023) | – | – | – | (200.972) | – |
| Aufwendungen insgesamt | | 114.303 | 158.208 | 380.172 | 568.958 | 1.193.201 | 381.738 | 27.806.292 | 357.320 |
| Finanzierungskosten | | | | | | | | | |
| Zinsaufwendungen | | – | 106 | 1.878 | 295 | 496 | 274 | 13.752 | 47 |
| Gezahlte Ausschüttungen | 1 | 548.922 | – | 242.312 | 250.739 | – | – | 89.100.366 | – |
| | | 548.922 | 106 | 244.190 | 251.034 | 496 | 274 | 89.114.118 | 47 |
| Quellensteuern | 1 | – | 2.143 | 6.303 | 335.421 | 377.588 | 287.847 | 193.502 | 47.134 |
| Kapitalertragsteuer | 1 | – | – | – | – | – | – | – | 4.532 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit | | (2.553.485) | (14.114.027) | (11.514.126) | (15.907.263) | (68.031.509) | (4.546.749) | (466.324.580) | (12.069.745) |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

| | | Japan Equity Engagement | Macro Opportunities FX | Multi-Asset Erträge | Next Generation Mobility | Next Generation Space Economy | Responsible Asian Debt - Hard Currency | Short Duration Emerging Market Debt | Short Duration High Yield SDG Engagement |
|--|------|----------------------------|---------------------------|------------------------|-----------------------------|----------------------------------|--|---|---|
| | | Geschäftsjahr zum | Geschäftsjahr zum | Geschäftsjahr zum | Geschäftsjahr zum | Berichtszeitraum zum | Geschäftsjahr zum | Geschäftsjahr zum | Geschäftsjahr zum |
| | Anm. | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2022* | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2022 |
| | | JPY | EUR | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Erträge | | | | | | | | | |
| Zinserträge | 1 | – | 320.985 | 405.092 | 132.714 | 6.059 | 606.076 | 243.380.880 | 32.092.463 |
| Dividendenerträge | 1 | 414.616.230 | – | 311.350 | 1.633.835 | 67.962 | – | – | 124.934 |
| Erträge aus der Wertpapierleihe | 18 | – | – | – | – | – | – | 11.742 | 19.067 |
| Sonstige Erträge | | – | – | 2.621 | – | – | – | – | 36.380 |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten | 11 | (1.741.078.724) | (1.971.787) | (3.111.883) | (57.817.347) | (432.375) | (1.891.100) | (1.101.068.370) | (89.765.536) |
| | | (1.326.462.494) | (1.650.802) | (2.392.820) | (56.050.798) | (358.354) | (1.285.024) | (857.675.748) | (57.492.692) |
| Aufwendungen | | | | | | | | | |
| Managementgebühr | 6 | 100.811.266 | 168.525 | 191.307 | 2.355.835 | 38.201 | 98.138 | 31.402.765 | 3.565.600 |
| Vertriebsgebühren | 6 | – | 137 | 43.482 | 372.424 | 5.251 | 5.192 | 843.022 | 79.027 |
| Verwaltungsgebühren | 6 | 10.583.025 | 66.743 | 130.760 | 174.933 | 18.121 | 63.440 | 2.510.377 | 346.178 |
| Bereitstellungsprovision | 19 | 1.161.813 | 5.229 | 2.735 | 24.197 | 116 | 1.809 | 823.258 | 78.800 |
| Depotgebühren | 6 | 2.339.804 | 11.661 | 11.978 | 12.000 | 8.033 | 11.978 | 419.115 | 13.978 |
| Gebühren der Verwahrstelle | 6 | 927.073 | 1.776 | 933 | 8.609 | 109 | 715 | 283.218 | 27.328 |
| Honorare | 9 | 5.788.301 | 44.584 | 58.885 | 59.724 | 44.930 | 55.583 | 385.610 | 96.916 |
| Honorare der Direktoren | 7 | 645.304 | 4.290 | 4.408 | 6.008 | 3.292 | 4.413 | 4.408 | 6.008 |
| Transaktionskosten | 9 | 25.289.140 | 47.420 | 72.084 | 71.537 | 16.665 | 7.709 | 142.903 | 67.382 |
| Gründungsaufwendungen | 9 | – | – | – | – | 33.380 | – | – | – |
| Prüfungshonorare | 8 | 564.361 | 6.418 | 5.536 | 8.876 | 9.810 | 7.945 | 1.852 | – |
| Umsatzsteuerentlastung | | (109.192) | (221) | (95) | (808) | – | (55) | (27.820) | (2.514) |
| Sonstige Aufwendungen | 9 | 1.448.080 | 10.186 | 6.942 | 19.744 | 408 | 10.209 | 2.844 | 14.088 |
| Kostenverzicht | 6 | – | (110.430) | (244.304) | – | (91.761) | (137.097) | – | – |
| Verzicht auf Gebühren | 6 | – | – | – | – | – | – | – | (14.829) |
| Aufwendungen insgesamt | | 149.448.975 | 256.318 | 284.651 | 3.113.079 | 86.555 | 129.979 | 36.791.552 | 4.277.962 |
| Finanzierungskosten | | | | | | | | | |
| Zinsaufwendungen | | 2.090.931 | 386 | 413 | – | – | 179 | 54.957 | – |
| Gezahlte Ausschüttungen | 1 | – | 1.645 | 12.262 | – | – | 348.676 | 62.694.586 | 2.796.817 |
| | | 2.090.931 | 2.031 | 12.675 | – | – | 348.855 | 62.749.543 | 2.796.817 |
| Quellensteuern | 1 | 62.192.435 | – | 71.831 | 317.930 | 8.953 | – | – | – |
| Kapitalertragsteuer | 1 | – | – | (490) | – | – | – | – | – |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit | | (1.540.194.835) | (1.909.151) | (2.761.487) | (59.481.807) | (453.862) | (1.763.858) | (957.216.843) | (64.567.471) |

*Der Next Generation Space Economy wurde am 10. Mai 2022 aufgelegt.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

| | Strategic Income | Sustainable Asia High Yield | Sustainable Emerging Market Corporate Debt | Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022* | Ultra Short Term Euro Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 EUR | Uncorrelated Strategies Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$ | Uncorrelated Trading Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022** US\$ | US Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$ |
|--|--|--|--|--|--|--|--|--|
| Anm. | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$ | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$ | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$ | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022* US\$ | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 EUR | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$ | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022** US\$ | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$ |
| Erträge | | | | | | | | |
| Zinserträge | 1 | 49.594.262 | 2.538.288 | 5.944.374 | 5.638.541 | 21.554.078 | 1.912.636 | 15.809 |
| Dividendenerträge | 1 | 60.777 | – | – | – | – | 38 | 242.296 |
| Erträge aus der Wertpapierleihe | 18 | 21.952 | – | 151 | – | 36.550 | – | 2.477 |
| Sonstige Erträge | | 179.045 | – | 64 | – | 3.743 | 273 | 756 |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten | 11 | (245.259.988) | (18.519.194) | (28.879.284) | (21.709.100) | (78.146.103) | 4.170.627 | (5.354.167) |
| | | (195.403.952) | (15.980.906) | (22.934.695) | (16.070.559) | (56.551.732) | 6.083.574 | (5.092.829) |
| Aufwendungen | | | | | | | | |
| Managementgebühr | 6 | 8.737.824 | 198.639 | 836.649 | 386.207 | 1.556.522 | 3.988.226 | 148.193 |
| Vertriebsgebühren | 6 | 1.030.707 | – | 27.424 | – | 211 | – | 60 |
| Verwaltungsgebühren | 6 | 1.038.690 | 61.962 | 149.105 | 67.923 | 500.760 | 303.853 | 41.720 |
| Bereitstellungsprovision | 19 | 186.188 | 458 | 16.486 | 2.145 | 148.736 | 9.457 | 3.100 |
| Depotgebühren | 6 | 38.581 | 12.316 | 12.978 | 11.419 | 87.036 | 25.474 | 12.578 |
| Gebühren der Verwahrstelle | 6 | 67.232 | 1.352 | 5.695 | 3.564 | 52.628 | 18.195 | 1.056 |
| Honorare | 9 | 157.565 | 114.191 | 136.208 | 81.203 | 96.997 | 70.868 | 44.023 |
| Honorare der Direktoren | 7 | 5.708 | 5.536 | 6.008 | 4.693 | 4.289 | 3.292 | 4.408 |
| Erfolgsabhängige Gebühr | 6 | – | – | – | – | 75.878.127 | 1.351 | – |
| Transaktionskosten | 9 | 278.648 | 23.533 | 35.949 | 12.589 | 151.594 | 2.244.454 | 13.626 |
| Gründungsaufwendungen | 9 | – | – | – | 34.116 | – | 105.495 | – |
| Prüfungshonorare | 8 | 12.275 | 4.007 | 5.338 | 9.712 | 6.235 | 9.787 | 2.448 |
| Umsatzsteuerentlastung | | (6.168) | (331) | (602) | (659) | (5.258) | – | (63) |
| Sonstige Aufwendungen | 9 | 428 | 6.090 | 7.507 | 8.245 | 6.891 | 370.398 | 8.544 |
| Kostenverzicht | 6 | – | (160.143) | (165.230) | (53.094) | – | – | (81.644) |
| Verzicht auf Gebühren | 6 | (7.051) | – | – | – | – | – | – |
| Aufwendungen insgesamt | | 11.540.627 | 267.610 | 1.073.515 | 568.063 | 2.606.641 | 7.150.850 | 198.049 |
| Finanzierungskosten | | | | | | | | |
| Zinsaufwendungen | | 238 | 45 | 7.376 | 1.319 | – | 174.016 | 1.209 |
| Gezahlte Ausschüttungen | 1 | 8.334.033 | 270.363 | 286.367 | – | 22.323 | – | – |
| | | 8.334.271 | 270.408 | 293.743 | 1.319 | 22.323 | 174.016 | 1.209 |
| Quellensteuern | 1 | 487.232 | 12.927 | 28 | 108.561 | 14.929 | 4.333.351 | 66.696 |
| Kapitalertragsteuer | 1 | (63.251) | – | – | – | – | – | – |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit | | (215.702.831) | (16.531.851) | (24.301.981) | (16.748.502) | (59.195.625) | (1.222.875) | (5.358.783) |

* Der Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency wurde am 19. Januar 2022 aufgelegt.

** Der Uncorrelated Tradin Fund wurde am 14. Juni 2022 aufgelegt.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

| | Anm. | US Equity Index PutWrite Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$ | US Large Cap Value Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$ | US Long Short Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$ | US Multi Cap Opportunities Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$ | US Real Estate Securities Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$ | US Small Cap Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$ | US Small Cap Intrinsic Value Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$ | Fonds insgesamt* Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US\$ |
|--|------|--|--|--|--|---|---|--|---|
| Erträge | | | | | | | | | |
| Zinserträge | 1 | 4.282.751 | 780.830 | 960.562 | 28.718 | 175.899 | 161.231 | 172.395 | 991.009.766 |
| Dividendenerträge | 1 | – | 22.063.565 | 2.999.980 | 7.826.211 | 27.655.707 | 5.705.571 | 1.283.944 | 109.148.302 |
| Erträge aus der Wertpapierleihe | 18 | – | – | 67.468 | – | – | – | – | 611.992 |
| Sonstige Erträge | | – | – | 99.423 | – | – | 9.340 | – | 4.987.703 |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten | 11 | (87.672.202) | (27.395.274) | (36.844.968) | (150.019.669) | (301.673.396) | (155.375.348) | (39.191.641) | (6.379.690.095) |
| | | (83.389.451) | (4.550.879) | (32.717.535) | (142.164.740) | (273.841.790) | (149.499.206) | (37.735.302) | (5.273.932.332) |
| Aufwendungen | | | | | | | | | |
| Managementgebühr | 6 | 2.579.752 | 4.595.988 | 3.334.050 | 7.378.299 | 11.237.220 | 6.754.678 | 1.555.235 | 220.981.106 |
| Vertriebsgebühren | 6 | 13.247 | 119.897 | 41.179 | 909.109 | 2.002.809 | 729.500 | 5.331 | 11.861.633 |
| Verwaltungsgebühren | 6 | 365.241 | 473.775 | 193.545 | 514.127 | 1.401.818 | 462.685 | 133.735 | 21.323.731 |
| Bereitstellungsprovision | 19 | 85.448 | 21.713 | 31.545 | 92.632 | 122.751 | 78.869 | 25.463 | 3.978.990 |
| Depotgebühren | 6 | 11.978 | 14.473 | 12.000 | 12.678 | 13.121 | 13.116 | 12.578 | 3.500.933 |
| Gebühren der Verwahrstelle | 6 | 30.355 | 31.007 | 12.921 | 31.614 | 41.239 | 30.452 | 9.069 | 1.640.283 |
| Honorare | 9 | 102.534 | 100.402 | 65.729 | 138.031 | 188.463 | 132.690 | 55.026 | 5.741.188 |
| Honorare der Direktoren | 7 | 4.408 | 5.636 | 4.408 | 4.413 | 5.408 | 6.008 | 5.608 | 259.448 |
| Erfolgsabhängige Gebühr | 6 | – | – | – | – | – | – | – | 75.968.663 |
| Transaktionskosten | 9 | 129.938 | 570.124 | 172.070 | 282.497 | 502.855 | 283.573 | 89.127 | 36.341.706 |
| Gründungsaufwendungen | 9 | – | – | – | – | – | – | – | 248.619 |
| Prüfungshonorare | 8 | 4.727 | 5.832 | 5.893 | 4.670 | 2.286 | 3.785 | 7.040 | 321.771 |
| Umsatzsteuerentlastung | | (2.475) | (4.523) | (1.273) | (3.192) | (4.326) | (2.706) | (763) | (157.381) |
| Sonstige Aufwendungen | 9 | 9.112 | 11.137 | 84.198 | 10.161 | 12.037 | 12.304 | 14.150 | 6.586.467 |
| Kostenverzicht | 6 | – | – | – | – | – | – | – | (2.876.095) |
| Verzicht auf Gebühren | 6 | – | – | – | – | – | – | – | (227.107) |
| Aufwendungen insgesamt | | 3.334.265 | 5.945.461 | 3.956.265 | 9.375.039 | 15.525.681 | 8.504.954 | 1.911.599 | 385.493.955 |
| Finanzierungskosten | | | | | | | | | |
| Zinsaufwendungen | | – | 69.033 | 2 | 3.133 | 821 | 2.396 | – | 436.593 |
| Gezahlte Ausschüttungen | 1 | 5.382.746 | – | – | 13.581 | 7.297.490 | – | – | 282.296.687 |
| | | 5.382.746 | 69.033 | 2 | 16.714 | 7.298.311 | 2.396 | – | 282.733.280 |
| Quellensteuern | 1 | – | 5.986.352 | 764.464 | 2.248.107 | 7.595.368 | 1.678.872 | 334.116 | 33.280.542 |
| Kapitalertragsteuer | 1 | – | – | – | – | – | – | – | (1.666.490) |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit | | (92.106.462) | (16.551.725) | (37.438.266) | (153.804.600) | (304.261.150) | (159.685.428) | (39.981.017) | (5.973.773.619) |

Alle Erträge und Aufwendungen ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit – mit Ausnahme des Absolute Return Multi Strategy, der am 20. Dezember 2021 aufgelöst wurde. Außer den in der konsolidierten Gewinn- und Verlustrechnung ausgewiesenen gab es keine Gewinne und Verluste im Geschäftsjahr.

* Der konsolidierte Jahresabschluss wurde um Überkreuzinvestitionen zwischen den Portfolios bereinigt. Details zu Überkreuzinvestitionen zwischen Portfolios sind Anmerkung 10 der Anmerkungen zum geprüften Jahresabschluss zu entnehmen.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens

| | 5G Connectivity | Absolute Return Multi Strategy | China A-Share Equity | China Bond | China Equity | Climate Innovation Berichtszeitraum | CLO Income | Commodities |
|---|-------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| Anm. | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023* | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 | zum 31. Dezember 2023** | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 |
| | US\$ | US\$ | CNY | CNY | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres | 993.010.193 | – | 16.241.758 | 453.043.579 | 317.413.676 | – | 138.037.464 | 85.997.429 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit | 330.847.620 | – | (2.027.926) | 37.288.963 | (63.785.405) | (107.445) | 21.699.437 | (6.936.475) |
| Zeichnungen | 5 94.038.379 | – | – | 802.851 | 13.990.560 | 3.030.000 | 85.952.524 | 94.882.598 |
| Rücknahmen | 5 (374.369.249) | – | – | (32.289.285) | (89.392.544) | – | (60.043.120) | (20.296.993) |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres | 1.043.526.943 | – | 14.213.832 | 458.846.108 | 178.226.287 | 2.922.555 | 185.646.305 | 153.646.559 |

| | Corporate Hybrid Bond | Developed Market FMP – 2027 Berichtszeitraum | Emerging Market Debt - Hard Currency | Emerging Market Debt - Local Currency | Emerging Market Debt Blend | Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | Emerging Markets Equity | Emerging Markets Select Equity Berichtszeitraum |
|---|-------------------------------------|--|--------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
| Anm. | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 | zum 31. Dezember 2023*** | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 | zum 31. Dezember 2023**** |
| | EUR | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres | 1.782.154.808 | – | 2.491.704.928 | 1.386.264.443 | 470.181.480 | 54.274.381 | 191.807.755 | 93.762.122 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit | 124.965.012 | 5.457.030 | 297.691.613 | 141.712.762 | 54.178.232 | 3.538.481 | 9.563.366 | 2.762.893 |
| Zeichnungen | 5 657.882.054 | 138.602.529 | 1.047.274.763 | 231.862.147 | 124.905.703 | 53.127.987 | 87.850.549 | 901.671 |
| Rücknahmen | 5 (695.185.411) | (6.601.740) | (1.186.852.649) | (473.971.705) | (122.477.608) | (45.873.300) | (198.534.169) | (97.426.686) |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres | 1.869.816.463 | 137.457.819 | 2.649.818.655 | 1.285.867.647 | 526.787.807 | 65.067.549 | 90.687.501 | – |

* Der Absolute Return Multi Strategy wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

** Der Climate Innovation wurde am 1. August 2023 aufgelegt.

*** Der Neuberger Berman Developed Market FMP – 2027 wurde am 31. Juli 2023 aufgelegt.

**** Der Emerging Markets Select Equity wurde am 7. September 2023 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens (Fortsetzung)

| | Euro Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 EUR | Euro Bond Absolute Return Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 EUR | European High Yield Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 EUR | European Sustainable Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 EUR | Event Driven Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US\$ | Global Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US\$ | Global Diversified Income FMP – 2024 Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US\$ | Global Equity Megatrends Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US\$ |
|---|---|--|---|--|---|--|--|--|
| Anm. | | | | | | | | |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres | 9.294.742 | 48.527.876 | 32.454.528 | 175.854.230 | 41.446.672 | 134.811.296 | 160.396.086 | 79.344.365 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit | 751.195 | 2.896.736 | 22.874.571 | 29.936.586 | 8.295.425 | 7.287.720 | 5.135.348 | 19.600.362 |
| Zeichnungen | 5 527.157 | 691.146 | 373.361.838 | 27.413.412 | 105.767.010 | 12.172.804 | 36.761 | 73.983.326 |
| Rücknahmen | 5 – | (18.088.931) | (20.274.620) | (61.106.677) | (29.096.959) | (45.529.020) | (9.368.542) | (28.445.197) |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres | 10.573.094 | 34.026.827 | 408.416.317 | 172.097.551 | 126.412.148 | 108.742.800 | 156.199.653 | 144.482.856 |

| | Global Flexible Credit Income Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US\$ | Global High Yield SDG Engagement Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US\$ | Global High Yield Sustainable Action Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023* US\$ | Global Investment Grade Credit Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US\$ | Global Opportunistic Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US\$ | Global Real Estate Securities Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US\$ | Global Sustainable Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US\$ | Global Sustainable Value Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US\$ |
|---|---|--|---|--|---|---|---|--|
| Anm. | | | | | | | | |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres | 394.526.329 | 336.953.378 | 15.047.068 | 85.908.642 | 76.105.443 | 39.022.420 | 131.578.199 | 48.024.441 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit | 55.380.593 | 54.116.542 | 343.290 | 7.956.491 | 4.158.964 | 672.388 | 31.127.307 | 7.735.835 |
| Zeichnungen | 5 52.117.731 | 246.709.213 | – | 484.692 | 4.389.912 | 2.913.943 | 18.111.427 | 14.627.475 |
| Rücknahmen | 5 (111.411.672) | (79.615.228) | (15.390.358) | (7.572.000) | (19.244.556) | (22.148.738) | (26.243.638) | (14.921.857) |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres | 390.612.981 | 558.163.905 | – | 86.777.825 | 65.409.763 | 20.460.013 | 154.573.295 | 55.465.894 |

* Der Global High Yield Sustainable Action wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens (Fortsetzung)

| | High Yield Bond | InnovAsia 5G | Japan Equity Engagement | Macro Opportunities FX | Multi-Asset Income Berichtszeitraum | Next Generation Mobility | Next Generation Space Economy | Responsible Asian Debt - Hard Currency |
|---|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|--|
| Anm. | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 | zum 31. Dezember 2023* | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 |
| | US\$ | US\$ | JPY | EUR | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres | 2.298.751.712 | 14.748.993 | 20.542.667.585 | 31.510.156 | 11.366.115 | 148.004.677 | 8.490.862 | 21.626.209 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit | 144.477.255 | 5.241.350 | 4.836.098.350 | (763.083) | 236.464 | 40.203.709 | 3.269.553 | 2.750.828 |
| Zeichnungen | 5 561.207.918 | 6.477.592 | 7.483.761.065 | 8.167.159 | 24.302 | 24.503.776 | 8.813.182 | 50.126.106 |
| Rücknahmen | 5 (752.626.166) | (2.697.815) | (16.684.998.285) | (36.032.426) | (11.626.881) | (48.356.097) | (829.667) | (10.561.279) |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres | 2.251.810.719 | 23.770.120 | 16.177.528.715 | 2.881.806 | – | 164.356.065 | 19.743.930 | 63.941.864 |

| | Short Duration Emerging Market Debt | Short Duration High Yield SDG Engagement | Strategic Income | Sustainable Asia High Yield | Sustainable Emerging Market Corporate Debt | Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency | Tactical Macro Berichtszeitraum | Ultra Short Term Euro Bond |
|---|-------------------------------------|--|-------------------------------------|-------------------------------------|--|--|---------------------------------|-------------------------------------|
| Anm. | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 | zum 31. Dezember 2023** | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | EUR |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres | 5.124.661.750 | 556.373.679 | 1.322.805.855 | 31.922.271 | 98.244.308 | 158.420.594 | – | 821.390.067 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit | 276.312.077 | 38.090.157 | 88.223.360 | 541.427 | 8.656.916 | 41.175.536 | 716.419 | 58.088.664 |
| Zeichnungen | 5 913.802.369 | 477.921.105 | 1.129.764.227 | 21.287 | 5.980.010 | 350.525.367 | 26.445.889 | 466.117.965 |
| Rücknahmen | 5 (2.360.006.629) | (327.950.494) | (521.189.861) | (3.920.034) | (15.092.097) | (104.229.227) | – | (352.724.398) |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres | 3.954.769.567 | 744.434.447 | 2.019.603.581 | 28.564.951 | 97.789.137 | 445.892.270 | 27.162.308 | 992.872.298 |

* Der Multi-Asset Income wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

** Der Tactical Macro wurde am 30. Juni 2023 aufgelegt.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens (Fortsetzung)

| | Uncorrelated Strategies | Uncorrelated Trading | US Equity | US Equity Index PutWrite | US Large Cap Value | US Long Short Equity | US Multi Cap Opportunities | US Real Estate Securities |
|---|----------------------------|-------------------------|----------------------|-----------------------------|----------------------|-------------------------|-------------------------------|------------------------------|
| | Geschäftsjahr zum | Berichtszeitraum zum | Geschäftsjahr zum | Geschäftsjahr zum | Geschäftsjahr zum | Geschäftsjahr zum | Geschäftsjahr zum | Geschäftsjahr zum |
| Anm. | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2023* | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2023 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres | 3.130.486.982 | 711.942.710 | 31.464.829 | 680.456.738 | 1.767.954.359 | 221.529.901 | 441.315.950 | 648.025.795 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit | (148.818.353) | (14.165.514) | 9.066.626 | 109.770.608 | (54.391.287) | 27.000.196 | 67.319.121 | 42.410.727 |
| Zeichnungen | 5 901.511.546 | 11.358.695 | 10.264.274 | 214.235.309 | 791.197.422 | 53.782.532 | 97.292.578 | 93.896.935 |
| Rücknahmen | 5 (2.256.478.754) | (709.135.891) | (1.593.580) | (275.364.655) | (565.570.116) | (106.842.338) | (205.435.614) | (251.223.472) |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres | 1.626.701.421 | – | 49.202.149 | 729.098.000 | 1.939.190.378 | 195.470.291 | 400.492.035 | 533.109.985 |

| | US Small Cap | US Small Cap Intrinsic Value | Fonds insgesamt* |
|---|----------------------|---------------------------------|----------------------|
| | Geschäftsjahr zum | Geschäftsjahr zum | Geschäftsjahr zum |
| Anm. | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2023 |
| | US\$ | US\$ | US\$ |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres | 592.378.667 | 194.041.040 | 29.114.382.221 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit | 83.834.921 | 33.909.433 | 2.086.710.127 |
| Wechselkursbewegung | 15 – | – | 111.001.114 |
| Zeichnungen | 5 148.231.776 | 127.106.174 | 10.224.468.692 |
| Rücknahmen | 5 (190.593.595) | (33.488.030) | (13.212.229.398) |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres | 633.851.769 | 321.568.617 | 28.324.332.756 |

* Der Uncorrelated Trading wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

** Der konsolidierte Jahresabschluss wurde um Überkreuzinvestitionen zwischen den Portfolios bereinigt. Details zu Überkreuzinvestitionen zwischen Portfolios sind Anmerkung 10 der Anmerkungen zum geprüften Jahresabschluss zu entnehmen.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens (Fortsetzung)

| | 5G Connectivity | Absolute Return Multi Strategy | China A-Share Equity | China Bond | China Equity | CLO Income | Commodities Berichtszeitraum | Corporate Hybrid Bond |
|---|-------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|------------------------------|-------------------------------------|
| Anm. | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022* | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 | zum 31. Dezember 2022** | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | CNY | CNY | US\$ | US\$ | US\$ | EUR |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres | 2.395.521.641 | – | 24.427.958 | 580.753.658 | 529.341.191 | 149.839.432 | – | 2.458.411.975 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit | (961.044.302) | – | (5.664.222) | (9.221.023) | (115.468.447) | (24.133.828) | (1.611.554) | (312.428.965) |
| Zeichnungen | 5 197.172.123 | – | 133.524 | 47.011.277 | 200.374 | 30.409.011 | 104.395.961 | 845.732.739 |
| Rücknahmen | 5 (638.639.269) | – | (2.655.502) | (165.500.333) | (96.659.442) | (18.077.151) | (16.786.978) | (1.209.560.941) |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres | 993.010.193 | – | 16.241.758 | 453.043.579 | 317.413.676 | 138.037.464 | 85.997.429 | 1.782.154.808 |

| | Emerging Market Debt - Hard Currency | Emerging Market Debt - Local Currency | Emerging Market Debt Blend | Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | Emerging Markets Equity | Emerging Markets Select Equity | Euro Bond | Euro Bond Absolute Return |
|---|--------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|---|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| Anm. | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | EUR | EUR |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres | 3.612.575.490 | 2.102.682.652 | 947.581.444 | 47.386.279 | 388.690.425 | 125.356.269 | 11.211.336 | 54.164.845 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit | (809.494.034) | (309.993.190) | (167.989.052) | (8.895.817) | (104.473.315) | (30.931.205) | (1.966.594) | (1.736.050) |
| Zeichnungen | 5 1.181.314.266 | 200.530.321 | 109.802.796 | 25.051.224 | 75.505.768 | 2.830.898 | 50.000 | 21.594.998 |
| Rücknahmen | 5 (1.492.690.794) | (606.955.340) | (419.213.708) | (9.267.305) | (167.915.123) | (3.493.840) | – | (25.495.917) |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres | 2.491.704.928 | 1.386.264.443 | 470.181.480 | 54.274.381 | 191.807.755 | 93.762.122 | 9.294.742 | 48.527.876 |

* Der Absolute Return Multi Strategy wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

** Der Commodities wurde am 9. Februar 2022 aufgelegt.

Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens (Fortsetzung)

| | European High Yield Bond | European Sustainable Equity | Event Driven Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022* | Global Bond | Global Diversified Income FMP – 2024 | Global Equity Megatrends | Global Flexible Credit Income | Global High Yield SDG Engagement |
|---|-------------------------------------|-------------------------------------|--|-------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| Anm. | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022* | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 |
| | EUR | EUR | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres | 38.865.311 | 113.886.075 | – | 180.397.378 | 233.747.409 | 83.153.849 | 705.212.784 | 39.627.349 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit | (988.986) | (33.987.505) | 1.367.575 | (26.483.421) | (16.359.564) | (12.624.827) | (125.406.084) | (19.630.150) |
| Zeichnungen | 5 14.163.971 | 152.610.854 | 40.079.097 | 14.765.120 | 19.901 | 37.435.263 | 107.028.934 | 420.495.825 |
| Rücknahmen | 5 (19.585.768) | (56.655.194) | – | (33.867.781) | (57.011.660) | (28.619.920) | (292.309.305) | (103.539.646) |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres | 32.454.528 | 175.854.230 | 41.446.672 | 134.811.296 | 160.396.086 | 79.344.365 | 394.526.329 | 336.953.378 |

| | Global High Yield Sustainable Action | Global Investment Grade Credit | Global Opportunistic Bond | Global Real Estate Securities | Global Sustainable Equity | Global Sustainable Value | High Yield Bond | InnovAsia 5G |
|---|--------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| Anm. | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres | 17.600.553 | 98.810.202 | 94.244.831 | 50.887.571 | 203.986.580 | 20.888.250 | 3.203.355.473 | 26.794.987 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit | (2.553.485) | (14.114.027) | (11.514.126) | (15.907.263) | (68.031.509) | (4.546.749) | (466.324.580) | (12.069.745) |
| Zeichnungen | 5 – | 1.212.467 | 22.054.010 | 21.873.961 | 123.872.119 | 74.254.494 | 663.733.644 | 6.308.354 |
| Rücknahmen | 5 – | – | (28.679.272) | (17.831.849) | (128.248.991) | (42.571.554) | (1.102.012.825) | (6.284.603) |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres | 15.047.068 | 85.908.642 | 76.105.443 | 39.022.420 | 131.578.199 | 48.024.441 | 2.298.751.712 | 14.748.993 |

* Der Event Driven wurde am 26. Oktober 2022 aufgelegt.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens (Fortsetzung)

| | Japan Equity Engagement | Macro Opportunities FX | Multi-Asset Income | Next Generation Mobility | Next Generation Space Economy Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022* | Responsible Asian Debt - Hard Currency | Short Duration Emerging Market Debt | Short Duration High Yield SDG Engagement |
|---|-------------------------|------------------------|--------------------|--------------------------|---|--|-------------------------------------|--|
| | Geschäftsjahr zum | Geschäftsjahr zum | Geschäftsjahr zum | Geschäftsjahr zum | Geschäftsjahr zum | Geschäftsjahr zum | Geschäftsjahr zum | Geschäftsjahr zum |
| | Anm. 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2022* | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2022 |
| | JPY | EUR | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres | 12.105.937.644 | 44.609.891 | 22.705.351 | 220.483.316 | – | 14.429.520 | 6.934.454.095 | 644.439.910 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit | (1.540.194.835) | (1.909.151) | (2.761.487) | (59.481.807) | (453.862) | (1.763.858) | (957.216.843) | (64.567.471) |
| Zeichnungen | 5 16.188.114.198 | 20.283.746 | 1.394.430 | 39.564.733 | 8.972.341 | 18.601.061 | 1.374.964.811 | 191.676.597 |
| Rücknahmen | 5 (6.211.189.422) | (31.474.330) | (9.972.179) | (52.561.565) | (27.617) | (9.640.514) | (2.227.540.313) | (215.175.357) |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres | 20.542.667.585 | 31.510.156 | 11.366.115 | 148.004.677 | 8.490.862 | 21.626.209 | 5.124.661.750 | 556.373.679 |

| | Strategic Income | Sustainable Asia High Yield | Sustainable Emerging Market Corporate Debt | Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022** | Ultra Short Term Euro Bond | Uncorrelated Strategies | Uncorrelated Trading Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022*** | US Equity |
|---|------------------------|-----------------------------|--|---|----------------------------|-------------------------|--|-------------------|
| | Geschäftsjahr zum | Geschäftsjahr zum | Geschäftsjahr zum | Geschäftsjahr zum | Geschäftsjahr zum | Geschäftsjahr zum | Geschäftsjahr zum | Geschäftsjahr zum |
| | Anm. 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2022** | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2022*** | 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | EUR | US\$ | US\$ | US\$ |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres | 1.444.921.523 | 24.721.277 | 145.057.425 | – | 1.160.670.538 | 2.578.359.212 | – | 8.931.605 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit | (215.702.831) | (16.531.851) | (24.301.981) | (16.748.502) | (59.195.625) | (41.067.953) | (1.222.875) | (5.358.783) |
| Zeichnungen | 5 469.594.244 | 92.794.221 | 20.402.615 | 189.296.638 | 683.149.224 | 1.666.039.977 | 735.655.808 | 29.146.487 |
| Rücknahmen | 5 (376.007.081) | (69.061.376) | (42.913.751) | (14.127.542) | (963.234.070) | (1.072.844.254) | (22.490.223) | (1.254.480) |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres | 1.322.805.855 | 31.922.271 | 98.244.308 | 158.420.594 | 821.390.067 | 3.130.486.982 | 711.942.710 | 31.464.829 |

* Der Next Generation Space Economy wurde am 10. Mai 2022 aufgelegt.

** Der Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency wurde am 19. Januar 2022 aufgelegt.

** Der Uncorrelated Trading Fund wurde am 14. Juni 2022 aufgelegt.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens (Fortsetzung)

| | US Equity Index PutWrite | US Large Cap Value | US Long Short Equity | US Multi Cap Opportunities | US Real Estate Securities | US Small Cap | US Small Cap Intrinsic Value | Fonds insgesamt* |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 |
| Anm. | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres | 475.077.135 | 2.045.700 | 474.020.776 | 781.225.671 | 1.022.296.968 | 822.142.195 | 153.622.426 | 35.433.928.751 |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit | (92.106.462) | (16.551.725) | (37.438.266) | (153.804.600) | (304.261.150) | (159.685.428) | (39.981.017) | (5.973.773.619) |
| Wechselkursbewegung | 15 | – | – | – | – | – | – | (304.151.197) |
| Zeichnungen | 5 | 447.110.889 | 1.918.802.436 | 104.119.789 | 199.217.907 | 413.904.299 | 359.181.498 | 13.810.902.186 |
| Rücknahmen | 5 | (149.624.824) | (136.342.052) | (319.172.398) | (385.323.028) | (483.914.322) | (24.649.938) | (13.852.523.900) |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres | 680.456.738 | 1.767.954.359 | 221.529.901 | 441.315.950 | 648.025.795 | 592.378.667 | 194.041.040 | 29.114.382.221 |

* Der konsolidierte Jahresabschluss wurde um Überkreuzinvestitionen zwischen den Portfolios bereinigt. Details zu Überkreuzinvestitionen zwischen Portfolios sind Anmerkung 10 der Anmerkungen zum geprüften Jahresabschluss zu entnehmen.

Aufstellungen der wesentlichen Käufe und Verkäufe (ungeprüft)

In Einklang mit den EG-Richtlinien über Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren („European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations, 2011“) (in ihrer geltenden Fassung) wird eine Aufstellung über die Entwicklung der Zusammensetzung des Wertpapierbestands im Berichtszeitraum vorgelegt, um sicherzustellen, dass die Anteilhaber Veränderungen in den vom Portfolio gehaltenen Anlagen identifizieren können. Die folgenden Aufstellungen geben die gesamten Käufe und Verkäufe von Wertpapieren, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe und Verkäufe im Berichtszeitraum übersteigen, wieder. Es werden mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe aufgeführt, falls zutreffend.

5G Connectivity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|-----------|--|-------------|
| 252.400 | Lasertec Corp | 41.039.953 |
| 1.776.000 | Maxscend Microelectronics Co Ltd Class A | 36.203.846 |
| 695.046 | STMicroelectronics NV | 32.825.887 |
| 114.599 | NVIDIA Corp | 32.669.777 |
| 451.000 | Alchip Technologies Ltd | 32.161.673 |
| 239.816 | Amazon.com Inc | 31.861.122 |
| 204.200 | Palo Alto Networks Inc | 31.637.442 |
| 168.347 | Workday Inc Class A | 30.131.723 |
| 120.693 | Meta Platforms Inc Class A | 30.108.063 |
| 208.900 | Disco Corp | 29.442.821 |
| 109.792 | Super Micro Computer Inc | 27.826.779 |
| 186.258 | Arista Networks Inc | 27.797.553 |
| 710.704 | Infineon Technologies AG | 27.662.794 |
| 151.655 | Analog Devices Inc | 27.607.231 |
| 1.472.900 | Renesas Electronics Corp | 26.264.153 |
| 37.855 | Broadcom Inc | 26.032.267 |
| 38.977 | ASML Holding NV | 25.213.655 |
| 124.866 | Salesforce Inc | 24.237.515 |
| 7.331.900 | Foxconn Industrial Internet Co Ltd Class A | 23.637.495 |
| 49.700 | Keyence Corp | 23.075.833 |
| 350.877 | Shopify Inc Class A | 22.410.723 |
| 907.651 | Deutsche Telekom AG | 21.385.332 |
| 37.537 | Lam Research Corp | 21.216.240 |
| 7.796 | Booking Holdings Inc | 20.564.460 |
| 4.398.000 | Quanta Computer Inc | 20.413.553 |
| 166.666 | QUALCOMM Inc | 20.096.909 |
| 104.953 | Atlassian Corp Class A | 19.802.536 |
| 8.492.000 | Wistron Corp | 19.294.932 |
| 65.699 | Microsoft Corp | 19.207.496 |
| 231.466 | SK Hynix Inc | 19.189.521 |
| 235.723 | ON Semiconductor Corp | 18.677.491 |
| 754.057 | Kanzhun Ltd ADR | 18.289.235 |
| 465.200 | TDK Corp | 18.106.266 |
| 482.625 | Pure Storage Inc Class A | 16.975.996 |
| 1.089.000 | Novatek Microelectronics Corp | 16.642.314 |
| 344.468 | Match Group Inc | 15.935.325 |
| 3.426.000 | Unimicron Technology Corp | 15.763.476 |
| 149.364 | BE Semiconductor Industries NV | 15.621.984 |

5G Connectivity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen: (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|---------|-----------------------|-------------|
| 533.506 | Juniper Networks Inc | 15.525.963 |
| 146.639 | Qorvo Inc | 15.313.693 |
| 136.620 | Dexcom Inc | 15.289.375 |
| 106.198 | T-Mobile US Inc | 15.144.838 |
| 60.947 | Enphase Energy Inc | 14.556.763 |
| 137.845 | Oracle Corp | 14.456.037 |

5G Connectivity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|-----------|--|-------------|
| 909.700 | Advantest Corp | 57.929.909 |
| 290.975 | Arista Networks Inc | 50.600.720 |
| 282.300 | Lasertec Corp | 47.153.026 |
| 106.667 | ASM International NV | 42.388.612 |
| 96.414 | HubSpot Inc | 41.627.951 |
| 87.531 | Monolithic Power Systems Inc | 40.117.788 |
| 981.361 | Marvell Technology Inc | 39.876.155 |
| 366.169 | Advanced Micro Devices Inc | 39.820.464 |
| 227.921 | Keysight Technologies Inc | 35.316.088 |
| 7.568.359 | Nokia OYJ ADR | 34.469.816 |
| 8.492.000 | Wistron Corp | 33.826.316 |
| 695.046 | STMicroelectronics NV | 32.557.807 |
| 175.057 | Analog Devices Inc | 31.097.975 |
| 853.000 | StarPower Semiconductor Ltd Class A | 30.379.701 |
| 5.987.000 | Unimicron Technology Corp | 29.914.900 |
| 4.398.000 | Quanta Computer Inc | 29.154.765 |
| 1.078.500 | SG Micro Corp Class A | 28.005.693 |
| 137.100 | Disco Corp | 27.228.511 |
| 733.231 | Cellnex Telecom SA | 26.979.786 |
| 838.109 | Taiyo Yuden Co Ltd | 26.570.433 |
| 131.706 | Workday Inc Class A | 25.357.015 |
| 126.304 | Cadence Design Systems Inc | 25.266.773 |
| 114.659 | Palo Alto Networks Inc | 25.217.444 |
| 1.776.000 | Maxscend Microelectronics Co Ltd Class A | 25.092.526 |
| 47.476 | ServiceNow Inc | 24.670.443 |
| 219.221 | CrowdStrike Holdings Inc Class A | 22.836.612 |
| 115.786 | Enphase Energy Inc | 22.773.523 |
| 374.138 | Fortinet Inc | 22.064.715 |
| 147.391 | Snowflake Inc Class A | 21.831.064 |
| 7.045 | Booking Holdings Inc | 20.045.781 |
| 53.633 | Netflix Inc | 19.772.989 |
| 411.301 | Wolfspeed Inc | 18.954.735 |
| 429.393 | Ciena Corp | 18.898.357 |
| 1.250.700 | Sungrow Power Supply Co Ltd Class A | 18.770.086 |
| 194.808 | Alphabet Inc Class C | 18.297.700 |
| 265.940 | Datadog Inc Class A | 18.217.697 |
| 126.028 | T-Mobile US Inc | 18.052.181 |
| 280.202 | Shopify Inc Class A | 16.006.922 |
| 246.575 | Micron Technology Inc | 15.861.037 |
| 147.906 | Amazon.com Inc | 15.625.592 |

China A-Share Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten CNY |
|---------|--|------------|
| 92.500 | China Construction Bank Corp Class A | 579.269 |
| 18.300 | CITIC Securities Co Ltd Class A | 400.611 |
| 16.800 | TongFu Microelectronics Co Ltd Class A | 363.512 |
| 30.000 | China Life Insurance Co Ltd - H Shares | 330.660 |
| 10.000 | JCET Group Co Ltd Class A | 314.489 |
| 1.100 | BYD Co Ltd Class A | 288.594 |
| 50.100 | Shenzhen MTC Co Ltd Class A | 270.562 |
| 2.600 | Sungrow Power Supply Co Ltd Class A | 263.112 |
| 2.700 | Wanhua Chemical Group Co Ltd Class A | 260.656 |
| 3.700 | Shenzhou International Group Holdings Ltd | 254.715 |
| 78.000 | China CITIC Bank Corp Ltd - H Shares | 253.428 |
| 24.000 | Poly Developments & Holdings Group Co Ltd Class A | 243.716 |
| 1.300 | Contemporary Amperex Technology Co Ltd Class A | 231.533 |
| 8.100 | Shenzhen Sunlord Electronics Co Ltd Class A | 230.548 |
| 1.307 | Advanced Micro-Fabrication Equipment Inc China Class A | 230.429 |
| 13.100 | Yizumi Holdings Co Ltd Class A | 230.005 |
| 3.700 | Jiangsu Yoke Technology Co Ltd Class A | 226.244 |
| 50.000 | Nexteer Automotive Group Ltd | 225.935 |
| 35.200 | Baoshan Iron & Steel Co Ltd Class A | 218.516 |
| 8.200 | Shenzhen YUTO Packaging Technology Co Ltd Class A | 212.383 |
| 16.800 | China Galaxy Securities Co Ltd Class A | 209.478 |
| 15.500 | Weichai Power Co Ltd Class A | 207.024 |
| 2.100 | Tsingtao Brewery Co Ltd Class A | 193.550 |
| 1.800 | Milkyway Chemical Supply Chain Service Co Ltd Class A | 190.602 |
| 3.232 | Giantec Semiconductor Corp Class A | 189.938 |
| 3.100 | Eoptolink Technology Inc Ltd | 182.572 |
| 28.000 | AK Medical Holdings Ltd | 179.997 |
| 1.800 | Proya Cosmetics Co Ltd Class A | 178.648 |
| 1.000 | Wuliangye Yibin Co Ltd Class A | 177.353 |
| 39.400 | China United Network Communications Ltd Class A | 176.891 |
| 650 | Suzhou Maxwell Technologies Co Ltd Class A | 176.112 |
| 26.000 | Simcere Pharmaceutical Group Ltd | 175.880 |
| 13.700 | China Merchants Shekou Industrial Zone Holdings Co Ltd Class A | 174.430 |
| 3.501 | Piesat Information Technology Co Ltd Class A | 174.399 |
| 20.700 | China Railway Group Ltd Class A | 173.988 |
| 6.100 | Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd Class A | 170.286 |
| 11.900 | First Tractor Co Ltd Class A | 164.229 |
| 5.600 | Chongqing Department Store Co Ltd Class A | 162.269 |
| 6.100 | Henan Shuanghui Investment & Development Co Ltd Class A | 159.456 |
| 53.000 | Sinotrans Ltd - H Shares | 155.131 |
| 3.600 | LONGi Green Energy Technology Co Ltd Class A | 155.060 |
| 18.000 | Yuexiu Property Co Ltd | 151.867 |
| 5.900 | Zhejiang Jiemei Electronic & Technology Co Ltd Class A | 151.489 |
| 781 | Anji Microelectronics Technology Shanghai Co Ltd Class A | 150.165 |

China A-Share Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen: (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten CNY |
|---------|--|------------|
| 12.000 | SciClone Pharmaceuticals Holdings Ltd | 148.114 |
| 1.759 | Amlogic Shanghai Co Ltd Class A | 147.210 |
| 1.800 | Alibaba Group Holding Ltd | 146.750 |
| 3.100 | Shenzhen Sunnypol Optoelectronics Co Ltd Class A | 141.369 |
| 37.000 | Q Technology Group Co Ltd | 140.511 |
| 9.500 | China Jushi Co Ltd Class A | 138.250 |
| 9.800 | Dongfang Electric Corp Ltd Class A | 137.743 |
| 2.346 | Suzhou Recodeal Interconnect System Co Ltd Class A | 134.491 |

China A-Share Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse CNY |
|---------|--|------------|
| 32.020 | Bank of Ningbo Co Ltd Class A | 802.577 |
| 6.800 | Guangzhou Kingmed Diagnostics Group Co Ltd Class A | 471.216 |
| 2.160 | Contemporary Amperex Technology Co Ltd Class A | 467.625 |
| 9.100 | Ping An Insurance Group Co of China Ltd Class A | 419.538 |
| 3.820 | Will Semiconductor Co Ltd Shanghai Class A | 396.960 |
| 28.300 | Poly Developments & Holdings Group Co Ltd Class A | 385.958 |
| 14.596 | LONGi Green Energy Technology Co Ltd Class A | 381.340 |
| 2.600 | Wuliangye Yibin Co Ltd Class A | 364.367 |
| 2.920 | Meituan Class B | 323.847 |
| 10.600 | China Merchants Bank Co Ltd Class A | 321.308 |
| 10.000 | JCET Group Co Ltd Class A | 317.286 |
| 1.100 | Tencent Holdings Ltd | 313.292 |
| 9.250 | Beijing Oriental Yuhong Waterproof Technology Co Ltd Class A | 308.331 |
| 3.700 | WuXi AppTec Co Ltd Class A | 304.828 |
| 9.800 | Tongwei Co Ltd Class A | 288.659 |
| 4.200 | Alibaba Group Holding Ltd | 284.324 |
| 8.200 | Luxshare Precision Industry Co Ltd Class A | 268.721 |
| 3.768 | Montage Technology Co Ltd Class A | 248.639 |
| 13.600 | Ming Yang Smart Energy Group Ltd Class A | 247.300 |
| 11.500 | CITIC Securities Co Ltd Class A | 241.019 |
| 3.300 | Bethel Automotive Safety Systems Co Ltd Class A | 233.404 |
| 4.433 | Guangdong Haid Group Co Ltd Class A | 219.085 |
| 1.307 | Advanced Micro-Fabrication Equipment Inc China Class A | 208.822 |
| 3.700 | Jiangsu Yoke Technology Co Ltd Class A | 203.404 |
| 26.700 | Jiangsu Changshu Rural Commercial Bank Co Ltd Class A | 187.582 |
| 15.354 | China Jushi Co Ltd Class A | 181.543 |
| 8.700 | Sinoma Science & Technology Co Ltd Class A | 179.186 |
| 13.000 | Sany Heavy Industry Co Ltd Class A | 178.385 |
| 41.910 | TCL Technology Group Corp Class A | 175.498 |
| 4.668 | Hundsun Technologies Inc Class A | 174.944 |
| 3.000 | Wingtech Technology Co Ltd Class A | 171.678 |
| 39.400 | China United Network Communications Ltd Class A | 170.996 |
| 3.700 | TCL Zhonghuan Renewable Energy Technology Co Ltd Class A | 168.501 |
| 5.200 | Chaozhou Three-Circle Group Co Ltd Class A | 156.822 |
| 6.300 | TongFu Microelectronics Co Ltd Class A | 155.604 |
| 26.000 | Simcere Pharmaceutical Group Ltd | 152.793 |
| 13.700 | China Merchants Shekou Industrial Zone Holdings Co Ltd Class A | 144.586 |
| 7.700 | WUS Printed Circuit Kunshan Co Ltd Class A | 142.187 |
| 37.000 | Q Technology Group Co Ltd | 139.659 |
| 2.400 | Yifeng Pharmacy Chain Co Ltd Class A | 137.698 |
| 1.920 | Hangzhou First Applied Material Co Ltd Class A | 133.999 |
| 3.100 | Shenzhen Sunnypol Optoelectronics Co Ltd Class A | 133.822 |

China Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten CNY |
|------------|--|------------|
| 55.000.000 | China Government Bond, 2.67%, 25/05/2033 | 55.333.655 |
| 30.000.000 | China Government Bond, 2.18%, 15/08/2026 | 29.791.250 |
| 20.000.000 | Bank of China Ltd, 4.01%, 22/11/2029 | 20.334.720 |
| 20.000.000 | China Southern Power Grid Co Ltd, 2.84%, 24/11/2025 | 19.919.840 |
| 20.000.000 | Industrial & Commercial Bank of China Ltd, 2.60%, 06/11/2023 | 19.619.800 |
| 20.000.000 | China Everbright Bank Co Ltd, 2.55%, 28/02/2023 | 19.556.420 |
| 20.000.000 | Bank of Communications Co Ltd, 2.33%, 13/06/2024 | 19.553.540 |
| 20.000.000 | China Citic Bank Corp, 2.49%, 22/05/2024 | 19.535.620 |
| 20.000.000 | Agricultural Bank of China Ltd, 2.63%, 23/04/2024 | 19.496.260 |
| 10.000.000 | Industrial & Commercial Bank of China Ltd, 4.15%, 21/01/2031 | 10.233.870 |
| 10.000.000 | Guotai Junan Securities Co Ltd, 3.16%, 15/02/2026 | 10.083.300 |
| 10.000.000 | China Resources Inc, 2.90%, 22/04/2025 | 10.078.090 |
| 10.000.000 | China Three Gorges Renewables Group Co Ltd, 2.65%, 21/02/2025 | 10.039.170 |
| 10.000.000 | Tianfeng Securities Co Ltd, 3.70%, 24/10/2023 | 10.018.630 |
| 10.000.000 | China Minmetals Corp, 2.54%, 04/11/2025 | 9.987.380 |
| 10.000.000 | Central Huijin Investment Ltd, 2.80%, 27/10/2026 | 9.985.900 |
| 10.000.000 | Central Huijin Investment Ltd, 2.44%, 11/11/2025 | 9.863.350 |
| 9.500.000 | China Government Bond, 2.39%, 15/11/2026 | 9.478.198 |
| 1.500.000 | ENN Clean Energy International Investment Ltd, 3.38%, 12/05/2026 | 9.369.430 |
| 1.000.000 | TFI Overseas Investment Ltd, 6.50%, 05/06/2024 | 6.980.133 |
| 1.000.000 | China Mengniu Dairy Co Ltd, 4.25%, 07/08/2023 | 6.867.066 |
| 1.000.000 | China Hongqiao Group Ltd, 6.25%, 08/06/2024 | 6.790.530 |
| 1.000.000 | Huarong Finance II Co Ltd, 5.50%, 16/01/2025 | 6.701.400 |
| 1.000.000 | Blossom Joy Ltd, 3.10%, 29/12/2049 | 6.586.031 |
| 1.000.000 | Studio City Finance Ltd, 6.00%, 15/07/2025 | 6.462.997 |
| 1.000.000 | Tencent Holdings Ltd, 3.98%, 11/04/2029 | 6.340.104 |
| 1.000.000 | Wynn Macau Ltd, 5.13%, 15/12/2029 | 5.588.909 |
| 6.000.000 | Country Garden Holdings Co Ltd, 0.00%, 12/03/2026 | 4.800.000 |

China Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse CNY |
|------------|--|------------|
| 30.000.000 | Bank of China Ltd, 4.84%, 11/10/2028 | 30.394.110 |
| 30.000.000 | Shanghai Pudong Development Bank Co Ltd, 2.44%, 15/02/2023 | 29.285.430 |
| 20.000.000 | Bank of China Ltd, 4.01%, 22/11/2029 | 20.386.600 |
| 20.000.000 | China Government Bond, 2.69%, 12/08/2026 | 20.231.400 |
| 20.000.000 | Central Huijin Investment Ltd, 3.52%, 26/09/2024 | 20.152.160 |
| 20.000.000 | GD Power Development Co Ltd, 3.33%, 06/07/2024 | 20.123.800 |
| 20.000.000 | Shenzhen Metro Group Co Ltd, 3.25%, 12/07/2024 | 20.060.840 |
| 20.000.000 | China Government Bond, 2.18%, 25/08/2025 | 20.021.460 |
| 20.000.000 | China Citic Bank Corp, 0.00%, 22/09/2023 | 19.660.988 |
| 20.000.000 | Industrial & Commercial Bank of China Ltd, 2.60%, 06/11/2023 | 19.640.020 |
| 20.000.000 | China Everbright Bank Co Ltd, 2.55%, 28/02/2023 | 19.504.660 |
| 2.000.000 | China Mengniu Dairy Co Ltd, 4.25%, 07/08/2023 | 13.734.202 |
| 10.000.000 | Industrial & Commercial Bank of China Ltd, 4.15%, 21/01/2031 | 10.337.070 |
| 10.000.000 | China Government Bond, 2.47%, 02/09/2024 | 10.050.170 |
| 10.000.000 | Tianfeng Securities Co Ltd, 3.70%, 24/10/2023 | 10.044.860 |
| 9.000.000 | China Government Bond, 2.67%, 25/05/2033 | 8.987.238 |
| 1.000.000 | SF Holding Investment Ltd, 4.13%, 26/07/2023 | 6.878.225 |
| 1.000.000 | China Construction Bank Corp, 1.00%, 04/08/2023 | 6.768.982 |
| 1.000.000 | Kunlun Energy Co Ltd, 3.75%, 13/05/2025 | 6.734.093 |
| 1.000.000 | Wynn Macau Ltd, 5.13%, 15/12/2029 | 5.744.886 |
| 2.000.000 | Unigroup International Holdings Ltd, 6.00%, 28/04/2023 | 5.700.394 |
| 6.000.000 | Country Garden Holdings Co Ltd, 0.00%, 12/03/2026 | 5.105.926 |
| 583.000 | Shui On Development Holding Ltd, 5.75%, 12/11/2023 | 4.087.573 |

China Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|-----------|---|-------------|
| 341.311 | Trip.com Group Ltd ADR | 12.868.669 |
| 1.766.919 | TCL Zhonghuan Renewable Energy Technology Co Ltd Class A | 11.880.799 |
| 509.000 | Meituan Class B | 8.740.839 |
| 144.483 | H World Group Ltd ADR | 7.267.873 |
| 665.000 | Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co Ltd Class A | 6.637.212 |
| 660.000 | Eve Energy Co Ltd Class A | 6.211.463 |
| 264.071 | Suzhou Maxwell Technologies Co Ltd Class A | 6.187.334 |
| 219.921 | Shenzhen Dynanonic Co Ltd Class A | 6.156.976 |
| 330.090 | Yunnan Energy New Material Co Ltd Class A | 4.747.874 |
| 400.000 | Jiangsu Hengli Hydraulic Co Ltd Class A | 3.925.868 |
| 4.014.000 | Zoomlion Heavy Industry Science & Technology Co Ltd Class A | 3.788.320 |
| 574.000 | China Resources Beer Holdings Co Ltd | 3.511.291 |
| 1.385.879 | Satellite Chemical Co Ltd Class A | 3.351.595 |
| 131.606 | ZTO Express Cayman Inc ADR | 3.108.582 |
| 495.922 | Ninestar Corp Class A | 3.102.146 |
| 499.898 | Luxshare Precision Industry Co Ltd Class A | 2.239.958 |
| 335.500 | Li Ning Co Ltd | 1.916.674 |
| 437.000 | Glodon Co Ltd, 22/07/2024 – Participatory Notes | 1.806.240 |
| 174.500 | Shenzhou International Group Holdings Ltd | 1.758.390 |
| 39.500 | Tencent Holdings Ltd | 1.548.839 |
| 1.650.000 | CSPC Pharmaceutical Group Ltd | 1.446.349 |
| 38.750 | Trip.com Group Ltd | 1.418.869 |
| 130.000 | Shenzhen Inovance Technology Co Ltd Class A | 1.291.947 |
| 446.000 | China Pacific Insurance Group Co Ltd - H Shares | 1.260.178 |
| 340.000 | Zhongsheng Group Holdings Ltd | 1.236.469 |
| 582.811 | Sany Heavy Industry Co Ltd Class A | 1.171.649 |

China Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|-----------|---|-------------|
| 3.116.000 | Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd Class A | 12.437.958 |
| 217.000 | Tencent Holdings Ltd | 10.038.167 |
| 741.000 | Wanhua Chemical Group Co Ltd Class A | 9.804.511 |
| 786.000 | Alibaba Group Holding Ltd | 9.447.102 |
| 3.533.007 | Jiangsu Eastern Shenghong Co Ltd Class A | 6.809.545 |
| 1.546.054 | JL Mag Rare-Earth Co Ltd Class A | 6.475.125 |
| 350.000 | JD.com Inc Class A | 6.244.163 |
| 144.483 | H World Group Ltd ADR | 5.976.985 |
| 2.208.648 | TCL Zhonghuan Renewable Energy Technology Co Ltd Class A | 5.874.644 |
| 1.169.000 | Akeso Inc | 5.628.706 |
| 351.873 | Shenzhen Dynanonic Co Ltd Class A | 5.330.260 |
| 1.799.000 | Haier Smart Home Co Ltd - H Shares | 5.287.173 |
| 7.278.000 | China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd | 5.279.154 |
| 191.082 | ZTO Express Cayman Inc ADR | 5.130.346 |
| 1.280.000 | China Resources Land Ltd | 5.114.127 |
| 1.190.500 | China Merchants Bank Co Ltd - H Shares | 4.718.151 |
| 660.000 | Eve Energy Co Ltd Class A | 4.385.902 |
| 6.698.000 | China National Building Material Co Ltd – H Shares | 4.254.914 |
| 5.299.600 | Man Wah Holdings Ltd | 4.215.779 |
| 1.757.400 | China Pacific Insurance Group Co Ltd - H Shares | 4.191.040 |
| 222.000 | Meituan Class B | 4.127.236 |
| 506.000 | Midea Group Co Ltd Class A | 3.806.964 |
| 850.000 | Luxshare Precision Industry Co Ltd Class A | 3.724.411 |
| 598.000 | China Resources Beer Holdings Co Ltd | 3.688.377 |
| 1.604.000 | Satellite Chemical Co Ltd Class A | 3.406.871 |
| 309.900 | Shenzhen Inovance Technology Co Ltd Class A | 2.896.790 |
| 3.400.000 | CSPC Pharmaceutical Group Ltd | 2.799.434 |
| 66.000 | Beijing Kingsoft Office Software Inc Class A | 2.795.482 |
| 354.800 | Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co Ltd Class A | 2.750.853 |
| 1.304.000 | SITC International Holdings Co Ltd | 2.704.741 |
| 596.000 | Shandong Hualu Hengsheng Chemical Co Ltd Class A | 2.654.070 |
| 710.500 | Li Ning Co Ltd | 2.526.352 |
| 285.000 | Yunnan Energy New Material Co Ltd Class A | 2.367.673 |
| 495.922 | Ninestar Corp Class A | 2.316.383 |
| 2.208.000 | Zoomlion Heavy Industry Science & Technology Co Ltd Class A | 1.953.569 |

Climate Innovation – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|---------|----------------------------|-------------|
| 6.435 | Bureau Verita SA | 178.781 |
| 5.164 | GFL Environmental Inc | 176.929 |
| 2.328 | Procore Technologies Inc | 176.787 |
| 3.222 | nVent Electric Plc | 175.324 |
| 3.228 | Howmet Aerospace Inc | 158.057 |
| 735 | Quanta Services Inc | 148.228 |
| 1.272 | DSM-Firmenich AG | 129.266 |
| 532 | SolarEdge Technologies Inc | 127.255 |
| 569 | Trane Technologies Plc | 113.442 |
| 1.576 | Kia Corp | 112.696 |
| 1.994 | Corteva Inc | 111.229 |
| 1.632 | Ingersoll Rand Inc | 106.995 |
| 3.130 | Green Plains Inc | 106.236 |
| 575 | Air Liquide SA | 102.361 |
| 3.000 | BYD Co Ltd - H Shares | 98.489 |
| 4.762 | Stellantis NV | 94.677 |
| 1.418 | GXO Logistics Inc | 94.180 |
| 1.400 | Hitachi Ltd | 92.762 |
| 272 | ANSYS Inc | 91.226 |
| 198 | LG Chem Ltd | 84.036 |
| 1.320 | CRH Plc | 78.527 |
| 470 | L&F Co Ltd | 76.820 |
| 675 | ON Semiconductor Corp | 72.995 |
| 650 | Xylem Inc | 72.841 |
| 1.676 | ABB Ltd | 66.095 |
| 5.339 | Iberdrola SA | 65.753 |
| 124 | LG Energy Solution Ltd | 54.244 |
| 513 | Arkema SA | 54.243 |
| 540 | ITT Inc | 54.087 |
| 170 | Ferrari NV | 54.000 |
| 322 | Clean Harbors Inc | 53.345 |
| 843 | Danone SA | 52.337 |
| 221 | Union Pacific Corp | 50.976 |
| 1.101 | NEXTracker Inc Class A | 42.680 |
| 790 | Copart Inc | 40.182 |
| 65 | Adobe Inc | 40.136 |

Climate Innovation – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Verkäufe insgesamt:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|---------|---------------------------------------|-------------|
| 6.435 | Bureau Verita SA | 154.914 |
| 575 | Air Liquide SA | 106.664 |
| 1.994 | Corteva Inc | 92.504 |
| 1.418 | GXO Logistics Inc | 87.600 |
| 272 | ANSYS Inc | 84.682 |
| 170 | Ferrari NV | 51.242 |
| 532 | SolarEdge Technologies Inc | 39.642 |
| 354 | ITT Inc | 35.334 |
| 82 | LG Chem Ltd | 30.680 |
| 80 | LG Energy Solution Ltd | 28.618 |
| 84 | Accenture Plc Class A | 27.111 |
| 382 | Ingersoll Rand Inc | 27.064 |
| 54 | Monolithic Power Systems Inc | 25.648 |
| 1.679 | Shoals Technologies Group Inc Class A | 24.090 |
| 169 | L&F Co Ltd | 19.646 |
| 90 | Trane Technologies Plc | 18.783 |
| 1.600 | Sungrow Power Supply Co Ltd Class A | 17.896 |
| 334 | ABB Ltd | 14.399 |
| 287 | Howmet Aerospace Inc | 14.247 |
| 200 | Hitachi Ltd | 13.899 |
| 178 | nVent Electric Plc | 10.158 |

CLO Income – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|-----------|---|-------------|
| 164.557 | iShares USD High Yield Corp Bond UCITS ETF | 15.057.896 |
| 2.043.974 | iShares USD Treasury Bond 0-1yr UCITS ETF | 10.329.645 |
| 5.500.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 11/07/2023 | 5.491.615 |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 05/12/2023 | 4.997.077 |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 09/01/2024 | 4.994.934 |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 14/11/2023 | 4.990.487 |
| 3.100.000 | Blackrock European CLO XIV DAC Series 14X Class E, 11.61%, 15/07/2036 | 3.240.069 |
| 2.970.000 | Otranto Park CLO DAC Series 1X Class E, 11.05%, 15/05/2035 | 3.057.011 |
| 3.000.000 | Symphony CLO 37 Ltd Series 2022-37X Class ER, 13.31%, 20/01/2037 | 3.000.000 |
| 3.000.000 | Aurium CLO III DAC Series 3X Class E, 8.87%, 16/04/2030 | 2.997.375 |
| 3.000.000 | Goldentree Loan Management US CLO 18 Ltd Series 2023-18X Class E, 12.93%, 20/01/2037 | 2.970.000 |
| 3.000.000 | Bayswater Park CLO Ltd Series 2023-1X Class E, 12.74%, 20/01/2037 | 2.940.000 |
| 3.000.000 | Euro-Galaxy VII CLO DAC Series 2019-7X Class ER, 10.16%, 25/07/2035 | 2.818.694 |
| 2.750.000 | GoldenTree Loan Management EUR CLO 4 DAC Series 4X Class ER, 10.04%, 20/07/2034 | 2.657.189 |
| 2.500.000 | AB BSL CLO 4 Ltd Series 2023-4X Class E, 13.48%, 20/04/2036 | 2.506.250 |
| 2.500.000 | Canyon Capital CLO 2023-1 Ltd Series 2023-1X Class E, 13.39%, 15/10/2036 | 2.475.000 |
| 2.250.000 | CVC Cordatus Loan Fund XXVI DAC Series 26X Class E, 12.36%, 15/01/2037 | 2.473.169 |
| 2.200.000 | Symphony CLO 35 Ltd Series 2022-35X Class ER, 12.90%, 24/10/2036 | 2.200.000 |
| 2.200.000 | Benefit Street Partners CLO XXXIII Ltd Series 2023-33X Class E, 7.64%, 25/01/2036 | 2.178.000 |
| 2.000.000 | Palmer Square European Loan Funding 2023-1 DAC Series 2023-1X Class E, 10.53%, 15/11/2032 | 2.102.229 |
| 2.000.000 | Voya CLO 2022-3 Ltd Series 2022-3X Class ER, 13.42%, 20/10/2036 | 2.000.000 |
| 2.000.000 | AGL CLO 22 Ltd Series 2022-22X Class E, 13.95%, 20/10/2035 | 1.999.400 |
| 2.000.000 | Symphony CLO 40 Ltd Series 2023-40X Class E, 13.13%, 14/01/2034 | 1.980.000 |
| 1.750.000 | Adagio X Eur CLO DAC Series X-X Class ER, 12.26%, 20/10/2037 | 1.752.774 |
| 1.700.000 | CVC Cordatus Loan Fund XXIII DAC Series 23X Class E, 11.22%, 25/04/2036 | 1.726.812 |
| 1.600.000 | Wellington Management CLO 1 Ltd Series 2023-1X Class E, 13.05%, 20/10/2036 | 1.568.000 |
| 1.500.000 | Avoca Static CLO I DAC Series 1X Class E, 10.97%, 15/10/2030 | 1.562.904 |
| 1.500.000 | Bain Capital Credit CLO 2023-4 Ltd Series 2023-4X Class E, 13.58%, 21/10/2036 | 1.492.500 |
| 1.500.000 | Avoca CLO XIII DAC Series 13X Class ERR, 10.16%, 15/04/2034 | 1.483.173 |
| 1.500.000 | Armada Euro CLO V DAC Series 5X Class E, 9.92%, 28/07/2034 | 1.482.344 |
| 1.650.000 | Vesey Park CLO DAC Series 1X Class E, 13.88%, 16/11/2032 | 1.481.563 |
| 1.500.000 | OCP CLO 2023-26 Ltd Series 2023-26X Class E, 13.57%, 17/04/2036 | 1.477.500 |
| 1.500.000 | MidOcean Credit CLO XI Ltd Series 2022-11X Class ER, 13.68%, 18/10/2033 | 1.470.000 |
| 1.500.000 | Goldentree Loan Management EUR CLO 3 DAC Series 3X Class E, 9.88%, 20/01/2032 | 1.411.205 |
| 1.400.000 | CVC Cordatus Loan Fund XXVII DAC Series 27X Class F, 14.32%, 15/04/2035 | 1.407.867 |
| 1.400.000 | Aqueduct European CLO 7-2022 DAC Series 2022-7X Class E, 11.12%, 15/03/2036 | 1.394.840 |
| 1.500.000 | Goldentree Loan Management EUR CLO 5 DAC Series 5X Class E, 9.22%, 20/04/2034 | 1.367.169 |
| 1.251.000 | OCP Euro CLO 2029-3 Ltd Series 2019-3X Class ER, 9.99%, 20/04/2033 | 1.237.535 |

CLO Income – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|-----------|--|-------------|
| 2.043.974 | iShares USD Treasury Bond 0-1yr UCITS ETF | 10.354.431 |
| 6.385.000 | Octagon Investment Partners XV Ltd Series 2013-1X Class ER, 11.80%, 19/07/2030 | 5.298.273 |
| 4.000.000 | Oha Loan Funding 2013-1 Ltd Series 2013-1X Class ER2, 9.82%, 23/07/2031 | 3.621.600 |
| 33.486 | iShares USD High Yield Corp Bond UCITS ETF | 3.008.382 |
| 3.000.000 | Invesco CLO 2022-1 Ltd Series 2022-1X Class D, 8.10%, 20/04/2035 | 2.868.930 |
| 2.500.000 | Palmer Square CLO Ltd Series 2020-3X Class ER, 13.23%, 15/11/2031 | 2.500.000 |
| 3.000.000 | Dryden 49 Senior Loan Fund Series 2017-49X Class E, 11.09%, 18/07/2030 | 2.476.800 |
| 2.289.000 | Providus CLO IV DAC Series 4X Class ER, 9.19%, 20/04/2034 | 2.314.136 |
| 2.500.000 | Voya CLO 2015-1 Ltd Series 2015-1X Class DR, 10.44%, 18/01/2029 | 1.896.375 |
| 2.000.000 | Trinitas CLO XII Ltd Series 2020-12X Class E, 11.76%, 25/04/2033 | 1.821.660 |
| 2.000.000 | Madison Park Funding XXX Ltd Series 2018-30X Class E, 10.53%, 15/04/2029 | 1.813.200 |
| 2.000.000 | Burnham Park CLO Ltd Series 2016-1X Class ER, 10.65%, 20/10/2029 | 1.785.400 |
| 2.000.000 | Dryden 60 CLO Ltd Series 2018-60X Class E, 11.18%, 15/07/2031 | 1.783.560 |
| 2.000.000 | Cifc Funding 2018-I Ltd Series 2018-1X Class E, 10.56%, 18/04/2031 | 1.757.000 |
| 2.000.000 | Ares XXXVII CLO Ltd Series 2015-4X Class DR, 11.73%, 15/10/2030 | 1.715.400 |
| 2.000.000 | Carlyle Global Market Strategies Series 2014-2RX Class D, 10.99%, 15/05/2031 | 1.670.000 |
| 2.000.000 | Chenango Park CLO Ltd Series 2018-1X Class D, 10.59%, 15/04/2030 | 1.593.100 |
| 1.485.000 | Otranto Park CLO DAC Series 1X Class E, 11.05%, 15/05/2035 | 1.567.018 |
| 1.050.000 | Cifc European Funding CLO III DAC Series 3X Class E, 8.79%, 15/01/2034 | 1.058.314 |
| 1.000.000 | AGL CLO 22 Ltd Series 2022-22X Class E, 13.95%, 20/10/2035 | 1.005.180 |
| 1.000.000 | Harvest CLO XXVII DAC Series 27X Class F, 12.03%, 15/07/2034 | 947.410 |
| 1.050.000 | Galaxy XIX CLO Ltd Series 2015-19X Class D1R, 11.80%, 24/07/2030 | 924.462 |
| 1.000.000 | BlackRock European CLO X DAC Series 10X Class FR, 12.02%, 15/10/2034 | 911.157 |
| 1.000.000 | Avoca CLO XXVI Designated Activity Co Series 26X Class F, 13.06%, 15/04/2035 | 908.471 |
| 1.000.000 | Long Point Park CLO Ltd Series 2017-1X Class D2, 10.39%, 17/01/2030 | 800.200 |

Commodities – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|------------|--|-------------|
| 15.805.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 24/11/2023 | 15.601.438 |
| 15.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 16/01/2024 | 14.890.396 |
| 13.550.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 28/09/2023 | 13.374.511 |
| 10.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 20/07/2023 | 9.880.170 |
| 10.135.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 25/01/2024 | 9.871.186 |
| 9.995.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 26/10/2023 | 9.867.947 |
| 10.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 01/02/2024 | 9.864.607 |
| 10.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 13/06/2023 | 9.844.391 |
| 10.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 27/02/2024 | 9.825.114 |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 26/12/2023 | 4.937.442 |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 23/01/2024 | 4.916.498 |
| 4.355.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 31/08/2023 | 4.296.899 |
| 3.755.000 | Oracle Corp, 3.40%, 08/07/2024 | 3.683.432 |
| 3.711.000 | AT&T Inc, 0.90%, 25/03/2024 | 3.601.972 |
| 3.397.000 | Enterprise Products Operating LLC, 3.90%, 15/02/2024 | 3.363.343 |
| 3.082.000 | Goldman Sachs Group Inc, 5.70%, 01/11/2024 | 3.080.490 |
| 3.015.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 28/11/2023 | 2.962.284 |
| 2.915.000 | Citigroup Inc, 6.96%, 17/03/2026 | 2.939.303 |
| 2.920.000 | Bank of America Corp, 6.48%, 25/04/2025 | 2.922.390 |
| 2.945.000 | Apple Inc, 3.00%, 09/02/2024 | 2.913.665 |
| 2.845.000 | Amazon.com Inc, 0.45%, 12/05/2024 | 2.739.605 |
| 2.415.000 | US Bancorp, 2.40%, 30/07/2024 | 2.342.526 |
| 2.299.000 | Amgen Inc, 3.63%, 22/05/2024 | 2.263.159 |
| 2.265.000 | JPMorgan Chase & Co, 6.01%, 23/06/2025 | 2.257.184 |
| 2.075.000 | National Rural Utilities Cooperative Finance Corp, 5.70%, 18/10/2024 | 2.072.249 |
| 2.045.000 | Morgan Stanley, 6.01%, 24/01/2025 | 2.040.323 |
| 2.095.000 | Simon Property Group LP, 2.00%, 13/09/2024 | 2.025.098 |
| 2.000.000 | American Express Co, 6.34%, 04/03/2025 | 2.006.861 |
| 2.000.000 | Protective Life Global Funding, 6.42%, 28/03/2025 | 2.005.820 |
| 2.000.000 | Volkswagen Group of America Finance LLC, 6.37%, 07/06/2024 | 2.003.434 |
| 2.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 29/06/2023 | 1.976.583 |
| 2.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 11/07/2023 | 1.973.452 |

Commodities – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Verkäufe insgesamt:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|-----------|--|-------------|
| 9.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 01/06/2023 | 8.977.917 |
| 6.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 16/01/2024 | 5.965.875 |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 26/12/2023 | 4.983.999 |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 24/11/2023 | 4.968.879 |
| 1.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 11/07/2023 | 993.839 |
| 675.000 | Starbucks Corp, 5.82%, 14/02/2024 | 675.018 |
| 250.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 18/05/2023 | 249.517 |

Corporate Hybrid Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten EUR |
|------------|--|------------|
| 83.700.000 | Volkswagen International Finance NV, 7.50%, 29/12/2049 | 84.426.875 |
| 64.600.000 | British Telecommunications Plc, 8.38%, 20/12/2083 | 75.111.500 |
| 59.100.000 | Elia Group SA, 5.85%, 29/12/2049 | 59.136.361 |
| 51.300.000 | Vattenfall AB, 6.88%, 17/08/2083 | 59.073.078 |
| 48.750.000 | British Telecommunications Plc, 4.25%, 23/11/2081 | 40.950.318 |
| 45.000.000 | Unibail-Rodamco-Westfield SE, 7.25%, 29/12/2049 | 40.541.250 |
| 40.400.000 | Bayer AG, 6.63%, 25/09/2083 | 40.068.328 |
| 38.000.000 | Vodafone Group Plc, 6.50%, 30/08/2084 | 37.777.700 |
| 37.300.000 | Bayer AG, 7.00%, 25/09/2083 | 37.142.032 |
| 37.000.000 | APA Infrastructure Ltd, 7.13%, 09/11/2083 | 36.889.320 |
| 34.400.000 | Vodafone Group Plc, 6.25%, 03/10/2078 | 31.317.685 |
| 30.600.000 | Orange SA, 5.38%, 29/12/2049 | 30.405.990 |
| 30.100.000 | Veolia Environnement SA, 5.99%, 29/12/2049 | 30.100.000 |
| 27.700.000 | Enel SpA, 6.38%, 29/12/2049 | 28.012.000 |
| 35.000.000 | EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG, 1.38%, 31/08/2081 | 27.675.625 |
| 25.000.000 | Orsted AS, 5.25%, 29/12/2049 | 24.760.000 |
| 36.371.000 | Heimstaden Bostad AB, 2.63%, 29/12/2049 | 21.759.898 |
| 20.500.000 | Iberdrola Finanzas SA, 4.88%, 29/12/2049 | 19.783.750 |
| 20.600.000 | Vattenfall AB, 2.50%, 29/06/2083 | 19.520.814 |
| 20.000.000 | Enbridge Inc, 8.25%, 15/01/2084 | 18.332.000 |
| 19.875.000 | Stedin Holding NV, 1.50%, 29/12/2049 | 17.030.250 |
| 19.500.000 | PPL Capital Funding Inc, 8.27%, 30/03/2067 | 16.448.290 |
| 15.000.000 | Telefonica Europe BV, 7.13%, 29/12/2049 | 15.360.000 |
| 15.000.000 | Electricite de France SA, 7.50%, 29/12/2049 | 15.342.500 |
| 16.860.000 | Heimstaden Bostad AB, 3.25%, 29/12/2049 | 13.217.950 |
| 16.200.000 | EDP - Energias de Portugal SA, 1.88%, 14/03/2082 | 12.250.500 |
| 12.079.000 | BP Capital Markets Plc, 3.25%, 29/12/2049 | 11.342.813 |
| 10.940.000 | Orange SA, 5.00%, 29/12/2049 | 10.940.000 |

Corporate Hybrid Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse EUR |
|------------|--|------------|
| 53.700.000 | Volkswagen International Finance NV, 3.88%, 29/12/2049 | 47.699.875 |
| 50.100.000 | Syensqo SA, 2.50%, 29/12/2049 | 44.731.900 |
| 51.500.000 | Bayer AG, 3.13%, 12/11/2079 | 44.666.250 |
| 55.000.000 | EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG, 1.38%, 31/08/2081 | 43.986.250 |
| 44.400.000 | Veolia Environnement SA, 2.50%, 29/12/2049 | 36.526.496 |
| 42.600.000 | Evonik Industries AG, 1.38%, 02/09/2081 | 35.175.000 |
| 43.400.000 | EDP - Energias de Portugal SA, 1.88%, 14/03/2082 | 33.087.500 |
| 34.310.000 | TenneT Holding BV, 2.37%, 29/12/2049 | 32.139.550 |
| 75.750.000 | AT Securities BV, 5.25%, 29/12/2049 | 30.390.866 |
| 30.600.000 | Volkswagen International Finance NV, 4.63%, 29/12/2049 | 27.496.750 |
| 28.900.000 | Volkswagen International Finance NV, 3.88%, 29/12/2049 | 24.086.350 |
| 31.500.000 | Paramount Global, 6.38%, 30/03/2062 | 23.652.349 |
| 28.100.000 | Terna - Rete Elettrica Nazionale, 2.38%, 29/12/2049 | 23.498.625 |
| 25.000.000 | EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG, 1.88%, 29/06/2080 | 22.530.000 |
| 18.800.000 | Vattenfall AB, 6.88%, 17/08/2083 | 21.741.831 |
| 18.000.000 | British Telecommunications Plc, 8.38%, 20/12/2083 | 20.974.829 |
| 20.800.000 | Electricite de France SA, 5.88%, 29/12/2049 | 20.423.862 |
| 20.600.000 | Vattenfall AB, 2.50%, 29/06/2083 | 19.019.814 |
| 17.700.000 | Orsted AS, 5.25%, 29/12/2049 | 18.031.875 |
| 20.200.000 | Veolia Environnement SA, 2.25%, 29/12/2049 | 17.937.900 |
| 19.000.000 | Bayer AG, 2.38%, 12/11/2079 | 17.385.000 |
| 16.800.000 | Elia Group SA, 2.75%, 29/12/2049 | 16.472.400 |
| 15.800.000 | Electricite de France SA, 7.50%, 29/12/2049 | 16.225.750 |
| 17.100.000 | Volkswagen International Finance NV, 3.50%, 29/12/2049 | 15.997.050 |
| 18.500.000 | BP Capital Markets Plc, 3.63%, 29/12/2049 | 15.933.125 |
| 18.500.000 | Rogers Communications Inc, 5.25%, 15/03/2082 | 15.422.202 |
| 14.100.000 | Electricite de France SA, 6.00%, 29/12/2049 | 15.217.192 |
| 14.600.000 | Elia Group SA, 5.85%, 29/12/2049 | 14.527.000 |
| 17.062.000 | Southern Co, 1.88%, 15/09/2081 | 13.524.738 |
| 13.705.000 | TotalEnergies SE, 1.75%, 29/12/2049 | 13.081.423 |
| 15.000.000 | Volkswagen International Finance NV, 4.38%, 29/12/2049 | 12.412.500 |
| 13.100.000 | Engie SA, 1.63%, 29/12/2049 | 12.035.625 |
| 12.900.000 | Bertelsmann SE & Co KGaA, 3.50%, 23/04/2075 | 11.722.875 |
| 10.600.000 | Orange SA, 5.38%, 29/12/2049 | 10.541.700 |
| 10.000.000 | BP Capital Markets Plc, 4.25%, 29/12/2049 | 10.266.085 |

Developed Market FMP – 2027 – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|-----------|---|-------------|
| 3.500.000 | BPCE SA, 4.88%, 01/04/2026 | 3.360.610 |
| 3.600.000 | Air Lease Corp, 3.63%, 01/04/2027 | 3.332.769 |
| 3.800.000 | Santander UK Group Holdings Plc, 1.67%, 14/06/2027 | 3.328.423 |
| 3.600.000 | Capital One Financial Corp, 3.65%, 11/05/2027 | 3.315.108 |
| 3.650.000 | AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 2.45%, 29/10/2026 | 3.272.789 |
| 3.600.000 | HSBC Holdings Plc, 1.59%, 24/05/2027 | 3.196.318 |
| 3.175.000 | Ford Motor Credit Co LLC, 6.95%, 10/06/2026 | 3.196.288 |
| 3.400.000 | Morgan Stanley, 3.95%, 23/04/2027 | 3.195.094 |
| 3.250.000 | General Motors Financial Co Inc, 5.00%, 09/04/2027 | 3.160.233 |
| 3.300.000 | Micron Technology Inc, 4.19%, 15/02/2027 | 3.127.799 |
| 3.200.000 | UBS Group AG, 4.55%, 17/04/2026 | 3.089.273 |
| 3.300.000 | Nationwide Building Society, 4.00%, 14/09/2026 | 3.077.421 |
| 3.250.000 | Lloyds Banking Group Plc, 3.75%, 11/01/2027 | 3.049.520 |
| 3.500.000 | Viatrix Inc, 2.30%, 22/06/2027 | 3.047.695 |
| 3.400.000 | Paramount Global, 2.90%, 15/01/2027 | 3.026.732 |
| 3.000.000 | Imperial Brands Finance Plc, 6.13%, 27/07/2027 | 3.009.070 |
| 2.970.000 | Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc, 5.75%, 15/04/2026 | 2.902.924 |
| 3.080.000 | Warnermedia Holdings Inc, 3.76%, 15/03/2027 | 2.867.313 |
| 2.795.000 | Bank of America Corp, 4.25%, 22/10/2026 | 2.674.097 |
| 3.000.000 | Global Payments Inc, 2.15%, 15/01/2027 | 2.669.784 |
| 3.000.000 | BNP Paribas SA, 1.68%, 30/06/2027 | 2.666.670 |
| 2.800.000 | American Tower Corp, 3.65%, 15/03/2027 | 2.621.691 |
| 3.000.000 | Stellantis Finance US Inc, 1.71%, 29/01/2027 | 2.606.540 |
| 2.775.000 | Rogers Communications Inc, 3.20%, 15/03/2027 | 2.561.630 |
| 2.650.000 | HCA Inc, 4.50%, 15/02/2027 | 2.558.241 |
| 2.650.000 | Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp, 4.50%, 15/12/2026 | 2.552.756 |
| 2.650.000 | Energy Transfer LP, 4.20%, 15/04/2027 | 2.518.011 |
| 2.675.000 | NatWest Group Plc, 1.64%, 14/06/2027 | 2.372.837 |
| 2.125.000 | Dell International LLC/EMC Corp, 4.90%, 01/10/2026 | 2.086.978 |
| 2.100.000 | Boeing Co, 5.04%, 01/05/2027 | 2.072.931 |
| 2.215.000 | Crown Castle Inc, 2.90%, 15/03/2027 | 2.027.813 |
| 2.075.000 | MPLX LP, 4.13%, 01/03/2027 | 1.987.045 |
| 2.000.000 | CNH Industrial Capital LLC, 1.45%, 15/07/2026 | 1.789.737 |
| 1.850.000 | HP Inc, 3.00%, 17/06/2027 | 1.700.341 |
| 1.750.000 | BAT Capital Corp, 4.70%, 02/04/2027 | 1.698.515 |
| 1.675.000 | Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer, 7.50%, 01/06/2025 | 1.684.581 |
| 1.725.000 | Hess Corp, 4.30%, 01/04/2027 | 1.663.843 |
| 1.640.000 | Vistra Operations Co LLC, 5.63%, 15/02/2027 | 1.587.067 |
| 1.700.000 | Carrier Global Corp, 2.49%, 15/02/2027 | 1.547.752 |
| 1.635.000 | Penn Entertainment Inc, 5.63%, 15/01/2027 | 1.537.084 |
| 1.425.416 | American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd, 5.50%, 20/04/2026 | 1.400.285 |
| 1.465.000 | New Fortress Energy Inc, 6.75%, 15/09/2025 | 1.397.719 |
| 1.475.000 | Broadcom Inc, 3.46%, 15/09/2026 | 1.395.613 |

Developed Market FMP – 2027 – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Verkäufe insgesamt:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|-----------|---|-------------|
| 1.300.000 | CNH Industrial Capital LLC, 1.45%, 15/07/2026 | 1.170.923 |
| 1.100.000 | Fiserv Inc, 2.25%, 01/06/2027 | 982.707 |
| 825.000 | Kinder Morgan Inc, 1.75%, 15/11/2026 | 737.088 |
| 500.000 | Energy Transfer LP, 5.63%, 01/05/2027 | 478.950 |
| 315.000 | Constellation Brands Inc, 4.35%, 09/05/2027 | 303.811 |
| 335.000 | Otis Worldwide Corp, 2.29%, 05/04/2027 | 303.446 |

Emerging Market Debt - Hard Currency – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|------------|---|-------------|
| 31.209.000 | Colombia Government International Bond, 7.50%, 02/02/2034 | 30.729.183 |
| 99.430.000 | Argentine Republic Government International Bond, 3.63%, 09/07/2035 | 30.599.149 |
| 28.783.000 | Guatemala Government Bond, 6.60%, 13/06/2036 | 29.045.021 |
| 86.212.000 | Argentine Republic Government International Bond, 0.75%, 09/07/2030 | 26.715.714 |
| 22.438.000 | Brazilian Government International Bond, 6.00%, 20/10/2033 | 22.076.971 |
| 20.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 28/03/2023 | 19.927.677 |
| 16.087.000 | Turkiye Government International Bond, 9.13%, 13/07/2030 | 15.978.865 |
| 15.039.000 | Panama Government International Bond, 6.40%, 14/02/2035 | 15.404.847 |
| 15.379.000 | Republic of Poland Government International Bond, 5.50%, 04/04/2053 | 14.678.414 |
| 14.099.000 | Costa Rica Government International Bond, 7.30%, 13/11/2054 | 13.554.024 |
| 13.390.000 | Dominican Republic International Bond, 6.00%, 22/02/2033 | 12.411.730 |
| 11.428.000 | Bank Gospodarstwa Krajowego, 5.13%, 22/02/2033 | 12.281.024 |
| 19.505.000 | El Salvador Government International Bond, 7.65%, 15/06/2035 | 11.102.425 |
| 16.570.000 | Panama Government International Bond, 4.50%, 01/04/2056 | 10.680.840 |
| 10.489.000 | Petrobras Global Finance BV, 6.50%, 03/07/2033 | 10.394.179 |
| 10.242.000 | Panama Government International Bond, 6.85%, 28/03/2054 | 10.375.550 |
| 10.472.000 | Chile Government International Bond, 4.95%, 05/01/2036 | 10.261.962 |
| 12.420.000 | Nigeria Government International Bond, 9.25%, 21/01/2049 | 10.106.775 |
| 13.993.000 | Nigeria Government International Bond, 8.25%, 28/09/2051 | 9.986.954 |
| 11.230.000 | Romanian Government International Bond, 3.75%, 07/02/2034 | 9.892.267 |
| 12.100.000 | Peruvian Government International Bond, 1.25%, 11/03/2033 | 9.856.699 |
| 9.596.000 | Turkiye Government International Bond, 9.38%, 14/03/2029 | 9.542.070 |
| 11.310.000 | Nigeria Government International Bond, 8.75%, 21/01/2031 | 9.302.475 |
| 8.930.000 | Romanian Government International Bond, 7.13%, 17/01/2033 | 8.870.348 |
| 9.900.000 | Romanian Government International Bond, 3.88%, 29/10/2035 | 8.691.727 |
| 10.240.000 | Angolan Government International Bond, 8.75%, 14/04/2032 | 8.612.403 |

Emerging Market Debt - Hard Currency – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|-------------|---|-------------|
| 99.458.675 | Argentine Republic Government International Bond, 0.75%, 09/07/2030 | 33.245.699 |
| 103.917.910 | Argentine Republic Government International Bond, 3.63%, 09/07/2035 | 26.945.044 |
| 26.060.000 | Dominican Republic International Bond, 6.00%, 22/02/2033 | 23.846.114 |
| 19.083.000 | Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd, 3.38%, 29/12/2049 | 18.593.074 |
| 22.950.000 | Petroleos Mexicanos, 7.69%, 23/01/2050 | 15.846.458 |
| 15.265.000 | Indonesia Government International Bond, 5.25%, 17/01/2042 | 15.052.495 |
| 14.691.000 | Paraguay Government International Bond, 4.95%, 28/04/2031 | 14.196.635 |
| 13.500.000 | Southern Gas Corridor CJSC, 6.88%, 24/03/2026 | 13.688.520 |
| 15.750.000 | Egypt Government International Bond, 8.70%, 01/03/2049 | 11.305.665 |
| 12.170.000 | Saudi Arabian Oil Co, 4.25%, 16/04/2039 | 10.550.497 |
| 10.887.000 | Oman Government International Bond, 6.75%, 17/01/2048 | 10.491.890 |
| 11.940.000 | Republic of Kenya Government International Bond, 8.00%, 22/05/2032 | 10.306.926 |
| 13.699.000 | Angolan Government International Bond, 9.13%, 26/11/2049 | 10.180.751 |
| 12.747.000 | Peruvian Government International Bond, 1.25%, 11/03/2033 | 10.116.743 |
| 7.800.000 | Indonesia Government International Bond, 8.50%, 12/10/2035 | 9.596.816 |
| 19.123.467 | Ecuador Government International Bond, 6.00%, 31/07/2030 | 9.586.129 |
| 8.930.000 | Romanian Government International Bond, 7.13%, 17/01/2033 | 9.460.641 |
| 10.018.000 | Republic of Uzbekistan International Bond, 5.38%, 20/02/2029 | 9.246.187 |
| 12.028.000 | Turkey Government International Bond, 6.00%, 14/01/2041 | 9.140.932 |
| 12.589.000 | Colombia Government International Bond, 5.00%, 15/06/2045 | 8.751.633 |
| 12.100.000 | Republic of South Africa Government International Bond, 5.75%, 30/09/2049 | 8.496.954 |
| 10.849.000 | Colombia Government International Bond, 3.00%, 30/01/2030 | 8.477.261 |
| 8.973.750 | Iraq International Bond, 5.80%, 15/01/2028 | 8.408.668 |
| 9.432.000 | Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd, 2.30%, 08/01/2031 | 8.209.336 |
| 8.022.000 | Mongolia Government International Bond, 8.75%, 09/03/2024 | 8.070.599 |
| 11.262.000 | Republic of Kenya Government International Bond, 8.25%, 28/02/2048 | 7.774.790 |
| 7.595.000 | First Abu Dhabi Bank PJSC, 6.32%, 04/04/2034 | 7.702.849 |
| 23.087.184 | Argentine Republic Government International Bond, 1.00%, 09/07/2029 | 7.648.067 |

Emerging Market Debt - Local Currency – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|-----------------|--|-------------|
| 1.035.931.925 | Republic of South Africa Government Bond, 7.00%, 28/02/2031 | 47.399.374 |
| 667.331.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 7.00%, 15/02/2033 | 45.064.388 |
| 39.853.600 | United States Treasury Bill, 0.00%, 18/05/2023 | 39.407.275 |
| 40.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 10/08/2023 | 39.099.606 |
| 122.011.000 | Republic of Poland Government Bond, 7.50%, 25/07/2028 | 31.442.150 |
| 103.835.300.000 | Colombian TES, 13.25%, 09/02/2033 | 27.756.892 |
| 587.553.766 | Republic of South Africa Government Bond, 8.88%, 28/02/2035 | 27.546.839 |
| 26.024.800 | United States Treasury Bill, 0.00%, 17/08/2023 | 25.434.587 |
| 24.708.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 07/12/2023 | 24.291.986 |
| 9.435.460.000 | Hungary Government Bond, 4.75%, 24/11/2032 | 23.189.701 |
| 392.690.000 | Mexican Bonos, 7.50%, 26/05/2033 | 20.802.369 |
| 114.491.000 | Republic of Poland Government Bond, 1.75%, 25/04/2032 | 20.703.500 |
| 4.206.696.000 | Mexico Cetes, 0.00%, 06/02/2025 | 18.976.927 |
| 416.857.507 | Republic of South Africa Government Bond, 8.75%, 31/01/2044 | 18.838.513 |
| 17.716.200 | United States Treasury Bill, 0.00%, 30/01/2024 | 17.440.709 |
| 17.621.100 | United States Treasury Bill, 0.00%, 29/02/2024 | 17.239.031 |
| 318.866.689 | Republic of South Africa Government Bond, 10.50%, 21/12/2026 | 16.766.627 |
| 401.939.545 | Republic of South Africa Government Bond, 8.75%, 28/02/2048 | 16.700.178 |
| 477.597.049 | Republic of South Africa Government Bond, 6.25%, 31/03/2036 | 15.976.525 |
| 67.398.000 | Malaysia Government Bond, 4.70%, 15/10/2042 | 15.680.949 |
| 5.807.160.000 | Hungary Government Bond, 6.75%, 22/10/2028 | 15.192.341 |
| 523.577.000 | Thailand Government Bond, 3.35%, 17/06/2033 | 15.087.508 |
| 220.290.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 7.13%, 15/06/2038 | 14.912.223 |
| 273.118.642 | Turkey Government Bond, 1.50%, 18/06/2025 | 14.794.118 |
| 781.360.000 | Philippine Government Bond, 6.75%, 15/09/2032 | 14.014.373 |
| 57.075.000 | Malaysia Government Bond, 4.89%, 08/06/2038 | 13.881.223 |
| 55.140.000 | Romania Government Bond, 4.40%, 25/09/2023 | 12.194.570 |
| 493.856.000 | Uruguay Government International Bond, 8.50%, 15/03/2028 | 11.766.744 |
| 80.000.000 | China Development Bank, 3.30%, 03/03/2026 | 11.758.537 |
| 272.154.491 | Republic of South Africa Government Bond, 8.50%, 31/01/2037 | 11.163.600 |
| 173.110.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 6.63%, 15/02/2034 | 11.121.923 |

Emerging Market Debt - Local Currency – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|-----------------|--|-------------|
| 1.277.070.000 | Mexican Bonos, 7.75%, 29/05/2031 | 65.195.375 |
| 1.242.505.692 | Republic of South Africa Government Bond, 8.88%, 28/02/2035 | 55.096.055 |
| 1.112.795.378 | Republic of South Africa Government Bond, 7.00%, 28/02/2031 | 50.635.323 |
| 1.119.819.047 | Republic of South Africa Government Bond, 8.50%, 31/01/2037 | 48.261.624 |
| 39.853.600 | United States Treasury Bill, 0.00%, 18/05/2023 | 39.762.757 |
| 40.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 10/08/2023 | 39.616.669 |
| 584.621.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 7.00%, 15/02/2033 | 39.293.991 |
| 175.207.000 | Republic of Poland Government Bond, 2.50%, 25/07/2026 | 35.678.875 |
| 482.683.530 | Republic of South Africa Government Bond, 10.50%, 21/12/2026 | 29.651.427 |
| 26.024.800 | United States Treasury Bill, 0.00%, 17/08/2023 | 25.595.391 |
| 4.206.696.000 | Mexico Cetes, 0.00%, 06/02/2025 | 20.754.908 |
| 291.739.176 | Turkey Government Bond, 1.50%, 18/06/2025 | 19.713.645 |
| 587.994.000 | Thailand Government Bond, 1.45%, 17/12/2024 | 17.861.687 |
| 97.612.900.000 | Colombian TES, 7.00%, 26/03/2031 | 17.618.097 |
| 17.621.100 | United States Treasury Bill, 0.00%, 29/02/2024 | 17.427.336 |
| 5.807.160.000 | Hungary Government Bond, 6.75%, 22/10/2028 | 15.593.181 |
| 57.795.300.000 | Colombian TES, 13.25%, 09/02/2033 | 15.513.999 |
| 509.670.000 | Thailand Government Bond, 2.40%, 17/12/2023 | 15.307.096 |
| 213.305.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 8.13%, 15/05/2024 | 14.572.442 |
| 344.310.000 | Czech Republic Government Bond, 2.40%, 17/09/2025 | 14.492.410 |
| 485.120.000 | Thailand Government Bond, 2.00%, 17/12/2031 | 13.193.284 |
| 55.140.000 | Romania Government Bond, 4.40%, 25/09/2023 | 12.447.139 |
| 67.215.000 | Republic of Poland Government Bond, 0.25%, 25/10/2026 | 12.327.025 |
| 289.994.714 | Republic of South Africa Government Bond, 8.75%, 31/01/2044 | 12.241.347 |

Emerging Market Debt Blend – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|-----------------|--|-------------|
| 148.618.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 7.00%, 15/02/2033 | 10.121.580 |
| 220.312.572 | Republic of South Africa Government Bond, 7.00%, 28/02/2031 | 10.042.718 |
| 28.137.000 | Republic of Poland Government Bond, 7.50%, 25/07/2028 | 7.276.636 |
| 24.881.600.000 | Colombian TES, 13.25%, 09/02/2033 | 6.678.244 |
| 122.707.805 | Republic of South Africa Government Bond, 8.88%, 28/02/2035 | 5.765.897 |
| 29.163.000 | Republic of Poland Government Bond, 1.75%, 25/04/2032 | 5.284.742 |
| 93.410.100 | Mexican Bonos, 8.50%, 31/05/2029 | 5.091.837 |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 10/08/2023 | 4.887.451 |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 18/01/2024 | 4.886.861 |
| 1.950.450.000 | Hungary Government Bond, 4.75%, 24/11/2032 | 4.756.757 |
| 4.459.200 | United States Treasury Bill, 0.00%, 17/08/2023 | 4.358.070 |
| 105.368.165 | Republic of South Africa Government Bond, 8.75%, 28/02/2048 | 4.327.629 |
| 76.539.832 | Republic of South Africa Government Bond, 10.50%, 21/12/2026 | 4.078.738 |
| 113.833.220 | Republic of South Africa Government Bond, 6.25%, 31/03/2036 | 3.833.267 |
| 69.240.000 | Mexican Bonos, 7.50%, 26/05/2033 | 3.676.416 |
| 125.484.000 | Thailand Government Bond, 3.35%, 17/06/2033 | 3.661.649 |
| 67.630.000 | Mexican Bonos, 7.75%, 29/05/2031 | 3.607.911 |
| 15.151.000 | Malaysia Government Bond, 4.70%, 15/10/2042 | 3.506.194 |
| 69.430.000 | Mexican Bonos, 5.50%, 04/03/2027 | 3.402.624 |
| 1.209.860.000 | Hungary Government Bond, 6.75%, 22/10/2028 | 3.193.631 |
| 707.876.000 | Mexico Cetes, 0.00%, 06/02/2025 | 3.193.316 |
| 45.979.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 7.13%, 15/06/2038 | 3.136.152 |
| 57.445.500 | Turkey Government Bond, 1.50%, 18/06/2025 | 3.130.591 |
| 12.900.000 | Malaysia Government Bond, 4.89%, 08/06/2038 | 3.114.771 |
| 163.720.000 | Philippine Government Bond, 6.75%, 15/09/2032 | 2.936.254 |
| 44.347.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 6.88%, 15/04/2029 | 2.840.567 |
| 10.835.000 | Peru Government Bond, 6.15%, 12/08/2032 | 2.771.685 |

Emerging Market Debt Blend – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|-----------------|--|-------------|
| 248.469.039 | Republic of South Africa Government Bond, 8.88%, 28/02/2035 | 11.016.375 |
| 199.915.095 | Republic of South Africa Government Bond, 8.50%, 31/01/2037 | 8.540.737 |
| 158.150.000 | Mexican Bonos, 7.75%, 29/05/2031 | 8.127.911 |
| 179.163.271 | Republic of South Africa Government Bond, 7.00%, 28/02/2031 | 7.936.244 |
| 38.034.000 | Republic of Poland Government Bond, 2.50%, 25/07/2026 | 7.864.220 |
| 104.970.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 7.00%, 15/02/2033 | 7.072.622 |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 18/01/2024 | 4.977.385 |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 10/08/2023 | 4.936.875 |
| 4.459.200 | United States Treasury Bill, 0.00%, 17/08/2023 | 4.385.623 |
| 21.221.000 | Republic of Poland Government Bond, 2.75%, 25/10/2029 | 3.921.665 |
| 68.221.000 | Mexican Bonos, 8.50%, 31/05/2029 | 3.829.779 |
| 71.997.400 | Mexican Bonos, 7.50%, 03/06/2027 | 3.819.636 |
| 54.376.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 8.13%, 15/05/2024 | 3.720.292 |
| 707.876.000 | Mexico Cetes, 0.00%, 06/02/2025 | 3.492.504 |
| 50.721.840 | Turkey Government Bond, 1.50%, 18/06/2025 | 3.460.105 |
| 1.209.860.000 | Hungary Government Bond, 6.75%, 22/10/2028 | 3.249.103 |
| 11.923.200.000 | Colombian TES, 13.25%, 09/02/2033 | 3.192.880 |
| 53.664.271 | Republic of South Africa Government Bond, 10.50%, 21/12/2026 | 3.185.228 |
| 98.000.000 | Thailand Government Bond, 2.00%, 17/12/2031 | 2.644.861 |
| 91.000.000 | Thailand Government Bond, 2.65%, 17/06/2028 | 2.604.131 |
| 11.200.000 | Malaysia Government Bond, 3.80%, 17/08/2023 | 2.596.808 |

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|----------------|---|-------------|
| 16.632.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 7.00%, 15/02/2033 | 1.135.922 |
| 1.100.000 | Mexico Government International Bond, 6.35%, 09/02/2035 | 1.079.914 |
| 1.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 05/10/2023 | 991.817 |
| 1.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 07/12/2023 | 982.684 |
| 1.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 18/01/2024 | 976.914 |
| 700.000 | Panama Government International Bond, 6.70%, 26/01/2036 | 755.650 |
| 750.000 | Panama Bonos del Tesoro, 6.38%, 25/07/2033 | 743.690 |
| 710.000 | Indonesia Government International Bond, 1.40%, 30/10/2031 | 619.472 |
| 665.000 | Romanian Government International Bond, 3.75%, 07/02/2034 | 591.741 |
| 460.000 | Philippine Government International Bond, 9.50%, 02/02/2030 | 589.950 |
| 586.800 | United States Treasury Bill, 0.00%, 18/05/2023 | 580.228 |
| 2.010.000 | Republic of Poland Government Bond, 7.50%, 25/07/2028 | 520.447 |
| 1.830.800.000 | Colombian TES, 13.25%, 09/02/2033 | 490.101 |
| 2.507.000 | Republic of Poland Government Bond, 1.75%, 25/04/2032 | 451.726 |
| 410.000 | Bank Gospodarstwa Krajowego, 5.13%, 22/02/2033 | 444.913 |
| 16.000.000 | Thailand Government Bond, 0.75%, 17/09/2024 | 432.161 |
| 6.270.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 7.13%, 15/06/2038 | 427.880 |
| 588.000 | Panama Government International Bond, 4.50%, 19/01/2063 | 423.003 |
| 1.736.000 | Malaysia Government Bond, 4.70%, 15/10/2042 | 405.337 |
| 13.168.000 | Thailand Government Bond, 3.35%, 17/06/2033 | 393.446 |
| 5.700.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 6.88%, 15/04/2029 | 361.501 |
| 6.850.000 | Mexican Bonos, 7.50%, 26/05/2033 | 358.876 |
| 1.267.000 | Peru Government Bond, 6.15%, 12/08/2032 | 318.889 |
| 126.050.000 | Hungary Government Bond, 4.75%, 24/11/2032 | 312.741 |
| 400.000 | Kazakhstan Government International Bond, 1.50%, 30/09/2034 | 311.196 |
| 116.760.000 | Hungary Government Bond, 6.75%, 22/10/2028 | 309.194 |

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|---------------|---|-------------|
| 1.142.000 | Panama Government International Bond, 6.70%, 26/01/2036 | 1.191.039 |
| 1.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 05/10/2023 | 993.992 |
| 1.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 07/12/2023 | 984.780 |
| 1.100.000 | Chile Government International Bond, 0.83%, 02/07/2031 | 941.706 |
| 11.983.400 | Mexican Bonos, 8.50%, 31/05/2029 | 670.724 |
| 9.706.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 7.00%, 15/02/2033 | 652.146 |
| 841.000 | Mexico Government International Bond, 2.25%, 12/08/2036 | 647.227 |
| 430.000 | Panama Government International Bond, 9.38%, 01/04/2029 | 513.794 |
| 400.000 | Philippine Government International Bond, 9.50%, 02/02/2030 | 484.286 |
| 2.293.000 | Republic of Poland Government Bond, 2.50%, 25/07/2026 | 470.916 |
| 540.000 | Peruvian Government International Bond, 1.25%, 11/03/2033 | 431.640 |
| 300.000 | Peruvian Government International Bond, 8.75%, 21/11/2033 | 358.989 |
| 340.000 | Indonesia Government International Bond, 3.75%, 14/06/2028 | 354.785 |
| 300.000 | Indonesia Government International Bond, 6.63%, 17/02/2037 | 339.453 |
| 6.620.000 | Mexican Bonos, 7.75%, 29/05/2031 | 333.763 |
| 2.240.000 | China Government Bond, 3.28%, 03/12/2027 | 323.099 |
| 290.000 | Romanian Government International Bond, 7.13%, 17/01/2033 | 300.585 |
| 250.000 | Indonesia Government International Bond, 8.50%, 12/10/2035 | 299.058 |
| 284.000 | Republic of Poland Government International Bond, 5.50%, 04/04/2053 | 285.789 |
| 9.900.000 | Thailand Government Bond, 2.65%, 17/06/2028 | 282.439 |
| 99.150.000 | Hungary Government Bond, 6.75%, 22/10/2028 | 266.313 |
| 300.000 | Mexico Government International Bond, 5.75%, 12/10/2110 | 263.166 |
| 245.000 | Republic of Poland Government International Bond, 5.75%, 16/11/2032 | 259.700 |
| 981.100.000 | Colombian TES, 13.25%, 09/02/2033 | 257.875 |

Emerging Markets Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|-----------|--|-------------|
| 85.703 | Samsung Electronics Co Ltd | 4.221.130 |
| 45.113 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR | 4.149.085 |
| 81.200 | Tencent Holdings Ltd | 3.609.277 |
| 229.600 | Alibaba Group Holding Ltd | 2.653.415 |
| 27.699 | PDD Holdings Inc ADR | 2.526.515 |
| 36.735 | Rio Tinto Plc | 2.463.851 |
| 459.300 | Bangkok Bank PCL | 2.160.451 |
| 546.520 | NARI Technology Co Ltd Class A | 2.051.741 |
| 637.600 | CITIC Securities Co Ltd Class A | 1.985.107 |
| 3.226.000 | China Construction Bank Corp - H Shares | 1.908.870 |
| 200.918 | Banco do Brasil SA | 1.908.232 |
| 101.486 | Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV Class B | 1.854.122 |
| 800.340 | BDO Unibank Inc | 1.839.533 |
| 184.400 | Shenzhen Inovance Technology Co Ltd Class A | 1.808.692 |
| 107.260 | SM Investments Corp | 1.784.300 |
| 244.000 | Li Ning Co Ltd | 1.784.256 |
| 439.800 | Bank of Ningbo Co Ltd Class A | 1.779.108 |
| 208.770 | Grupo Financiero Banorte SAB de CV Class O | 1.771.169 |
| 197.500 | Midea Group Co Ltd Class A | 1.608.092 |
| 50.000 | BYD Co Ltd Class H | 1.577.696 |
| 41.821 | Trip.com Group Ltd ADR | 1.533.948 |
| 3.297 | NVIDIA Corp | 1.521.178 |
| 175.634 | Hypermarcas SA | 1.478.397 |
| 335.000 | Hua Hong Semiconductor Ltd | 1.474.610 |
| 1.900.303 | Adnoc Gas Plc | 1.444.957 |
| 24.463 | Las Vegas Sands Corp | 1.411.258 |
| 979.000 | China Longyuan Power Group Corp Ltd - H Shares | 1.376.487 |
| 79.800 | Sungrow Power Supply Co Ltd Class A | 1.272.907 |
| 10.334 | Baidu Inc ADR | 1.255.780 |
| 898.612 | Bharat Electronics Ltd | 1.252.896 |
| 16.004 | SK Hynix Inc | 1.249.586 |
| 53.904 | Samsung Engineering Co Ltd | 1.240.379 |
| 138.000 | Tsingtao Brewery Co Ltd - H Shares | 1.233.026 |

Emerging Markets Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|-----------|--|-------------|
| 159.259 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR | 14.256.879 |
| 236.700 | Tencent Holdings Ltd | 10.595.332 |
| 148.526 | Samsung Electronics Co Ltd | 7.527.371 |
| 568.200 | Alibaba Group Holding Ltd | 6.676.177 |
| 550.371 | ICICI Bank Ltd | 6.079.904 |
| 192.945 | JD.com Inc Class A | 4.378.749 |
| 119.304 | Reliance Industries Ltd | 3.497.327 |
| 872.942 | Wal-Mart de Mexico SAB de CV | 3.407.075 |
| 6.901 | LG Chem Ltd | 3.387.624 |
| 171.781 | HDFC Bank Ltd | 3.361.041 |
| 487.000 | Ping An Insurance Group Co of China Ltd - H Shares | 3.171.608 |
| 89.308 | Trip.com Group Ltd ADR | 3.157.369 |
| 31.900 | Dino Polska SA | 3.055.610 |
| 435.562 | State Bank of India | 3.051.140 |
| 562.727 | Itau Unibanco Holding SA | 2.957.986 |
| 747.000 | Chunghwa Telecom Co Ltd | 2.897.480 |
| 769.800 | Bank of Ningbo Co Ltd Class A | 2.854.248 |
| 37.406 | SK Hynix Inc | 2.832.763 |
| 1.201.000 | Uni-President Enterprises Corp | 2.790.733 |
| 87.712 | Anglo American Plc | 2.790.207 |
| 315.439 | Saudi Arabian Oil Co | 2.765.859 |
| 10.200 | Kweichow Moutai Co Ltd Class A | 2.589.199 |
| 669.000 | China Mengniu Dairy Co Ltd | 2.529.024 |
| 145.540 | Meituan Class B | 2.527.255 |
| 616.364 | Sichuan Kelun Pharmaceutical Co Ltd Class A | 2.509.472 |
| 17.373 | Credicorp Ltd | 2.359.376 |
| 106.589 | Bid Corp Ltd | 2.340.379 |

Emerging Markets Select Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|---------|--|-------------|
| 171.913 | Grupo Financiero Banorte SAB de CV Class O | 1.445.185 |
| 127.161 | Axis Bank Ltd | 1.424.997 |
| 162.000 | Midea Group Co Ltd Class A | 1.320.800 |
| 179.000 | Li Ning Co Ltd | 1.306.274 |
| 130.900 | Shenzhen Inovance Technology Co Ltd Class A | 1.281.518 |
| 14.006 | PDD Holdings Inc ADR | 1.243.403 |
| 73.800 | Sungrow Power Supply Co Ltd Class A | 1.185.159 |
| 36.500 | BYD Co Ltd - H Shares | 1.147.675 |
| 16.366 | Rio Tinto Plc | 1.111.893 |
| 290.600 | NARI Technology Co Ltd Class A | 1.098.266 |
| 48.480 | Samsung Engineering Co Ltd | 1.088.915 |
| 335.100 | CITIC Securities Co Ltd Class A | 1.043.862 |
| 17.275 | Las Vegas Sands Corp | 1.013.825 |
| 207.900 | Bangkok Bank PCL | 998.485 |
| 94.169 | Grupo Aeroportuario del Centro Norte SAB de CV Class B | 991.369 |
| 143.000 | Galaxy Entertainment Group Ltd | 988.029 |
| 32.797 | Larsen & Toubro Ltd | 983.165 |
| 157.000 | Chroma ATE Inc | 965.286 |
| 6.258 | Baidu Inc ADR | 945.061 |
| 359.500 | Foxconn Industrial Internet Co Ltd Class A | 818.575 |
| 416.480 | FIBRA Macquarie Mexico | 776.725 |
| 17.913 | Dixon Technologies India Ltd | 768.675 |
| 27.242 | Al-Dawaa Medical Services Co | 765.697 |
| 17.531 | H World Group Ltd ADR | 755.595 |
| 89.103 | Hypera SA | 754.176 |
| 4.100 | Naspers Ltd | 724.509 |
| 42.630 | SM Investments Corp | 719.913 |
| 304.220 | BDO Unibank Inc | 690.278 |
| 174.700 | Bank of Ningbo Co Ltd Class A | 667.661 |
| 4.082 | Globant SA | 652.237 |
| 72.000 | Tsingtao Brewery Co Ltd - H Shares | 645.679 |
| 909.246 | Borouge Plc | 641.328 |
| 51.283 | Saudi National Bank | 582.956 |
| 10.319 | Samsung Electronics Co Ltd | 530.889 |
| 41.800 | Alibaba Group Holding Ltd | 471.543 |
| 64.000 | E Ink Holdings Inc | 446.879 |
| 139.089 | Aptus Value Housing Finance India Ltd | 418.404 |

Emerging Markets Select Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|-----------|--|-------------|
| 513.000 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | 8.938.432 |
| 134.600 | Tencent Holdings Ltd | 5.752.760 |
| 105.796 | Samsung Electronics Co Ltd | 5.460.474 |
| 351.120 | Alibaba Group Holding Ltd | 4.192.100 |
| 150.180 | ICICI Bank Ltd ADR | 3.526.325 |
| 105.350 | JD.com Inc Class A | 2.379.404 |
| 25.561 | SK Hynix Inc | 2.318.346 |
| 75.313 | Reliance Industries Ltd | 2.281.846 |
| 17.662 | Dino Polska SA | 1.851.479 |
| 459.686 | Wal-Mart de Mexico SAB de CV | 1.798.354 |
| 6.600 | Kweichow Moutai Co Ltd Class A | 1.701.354 |
| 25.047 | HDFC Bank Ltd ADR | 1.663.564 |
| 43.695 | Trip.com Group Ltd ADR | 1.613.410 |
| 176.888 | Tsingtao Brewery Co Ltd - H Shares | 1.599.774 |
| 689.000 | Uni-President Enterprises Corp | 1.565.419 |
| 91.816 | IndusInd Bank Ltd | 1.562.408 |
| 69.092 | Bid Corp Ltd | 1.527.040 |
| 171.913 | Grupo Financiero Banorte SAB de CV Class O | 1.466.977 |
| 127.161 | Axis Bank Ltd | 1.462.353 |
| 391.100 | Bank of Ningbo Co Ltd Class A | 1.461.430 |
| 2.014.449 | Borouge Plc | 1.461.420 |
| 3.038 | LG Chem Ltd | 1.455.865 |
| 8.036 | Naspers Ltd | 1.377.642 |
| 22.538 | Apollo Hospitals Enterprise Ltd | 1.366.814 |
| 157.000 | Chroma ATE Inc | 1.361.256 |
| 494.964 | B3 SA - Brasil Bolsa Balcao | 1.335.814 |
| 48.480 | Samsung Engineering Co Ltd | 1.322.353 |

Euro Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten EUR |
|---------|--|------------|
| 400.000 | Thames Water Utilities Finance Plc, 4.38%, 18/01/2031 | 396.817 |
| 320.000 | Spain Government Bond, 3.55%, 31/10/2033 | 315.777 |
| 300.000 | European Union, 3.25%, 04/07/2034 | 295.573 |
| 200.000 | BNP Paribas SA, 7.38%, 29/12/2049 | 200.000 |
| 200.000 | Intesa Sanpaolo SpA, 6.18%, 20/02/2034 | 200.000 |
| 200.000 | NatWest Group Plc, 5.76%, 28/02/2034 | 200.000 |
| 200.000 | Morgan Stanley, 4.66%, 02/03/2029 | 200.000 |
| 200.000 | JPMorgan Chase & Co, 4.46%, 13/11/2031 | 200.000 |
| 200.000 | National Gas Transmission Plc, 4.25%, 05/04/2030 | 199.928 |
| 200.000 | Banco BPM SpA, 6.00%, 14/06/2028 | 199.910 |
| 200.000 | Toyota Motor Credit Corp, 4.05%, 13/09/2029 | 199.636 |
| 200.000 | HSBC Holdings Plc, 4.79%, 10/03/2032 | 199.590 |
| 215.000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.70%, 15/08/2032 | 199.500 |
| 200.000 | Linde Plc, 3.63%, 12/06/2034 | 199.410 |
| 200.000 | Caixa Central de Credito Agricola Mutuo CRL, 8.38%, 04/07/2027 | 199.362 |
| 200.000 | Athora Holding Ltd, 6.63%, 16/06/2028 | 199.322 |
| 200.000 | Thales SA, 4.13%, 18/10/2028 | 199.212 |
| 200.000 | Heathrow Funding Ltd, 4.50%, 11/07/2033 | 199.180 |
| 200.000 | BPCE SA, 4.75%, 14/06/2034 | 199.158 |
| 200.000 | VF Corp, 4.25%, 07/03/2029 | 199.140 |

Euro Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse EUR |
|---------|--|------------|
| 300.000 | Thames Water Utilities Finance Plc, 4.38%, 18/01/2031 | 299.947 |
| 200.000 | Telecom Italia SpA, 6.88%, 15/02/2028 | 203.301 |
| 200.000 | HSBC Holdings Plc, 4.79%, 10/03/2032 | 201.591 |
| 200.000 | Morgan Stanley, 4.66%, 02/03/2029 | 201.110 |
| 200.000 | JPMorgan Chase & Co, 4.46%, 13/11/2031 | 201.083 |
| 200.000 | BPCE SA, 4.75%, 14/06/2034 | 200.967 |
| 200.000 | National Gas Transmission Plc, 4.25%, 05/04/2030 | 200.920 |
| 200.000 | Intesa Sanpaolo SpA, 5.13%, 29/08/2031 | 200.820 |
| 200.000 | Engie SA, 4.50%, 06/09/2042 | 200.720 |
| 200.000 | Banco BPM SpA, 6.00%, 14/06/2028 | 200.684 |
| 200.000 | Toyota Motor Credit Corp, 4.05%, 13/09/2029 | 200.636 |
| 200.000 | NatWest Group Plc, 5.76%, 28/02/2034 | 200.512 |
| 200.000 | CRH SMW Finance DAC, 4.25%, 11/07/2035 | 200.408 |
| 200.000 | ZF Europe Finance BV, 6.13%, 13/03/2029 | 200.365 |
| 200.000 | BNP Paribas SA, 7.38%, 29/12/2049 | 200.160 |
| 200.000 | Linde Plc, 3.63%, 12/06/2034 | 200.004 |
| 200.000 | VF Corp, 4.25%, 07/03/2029 | 199.845 |
| 200.000 | Caixa Central de Credito Agricola Mutuo CRL, 8.38%, 04/07/2027 | 199.770 |
| 200.000 | Heathrow Funding Ltd, 4.50%, 11/07/2033 | 199.720 |
| 200.000 | Sartorius Finance BV, 4.50%, 14/09/2032 | 199.608 |

Euro Bond Absolute Return – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten EUR |
|------------|--|------------|
| 1.847.000 | Spain Government Bond, 3.55%, 31/10/2033 | 1.828.430 |
| 7.400.000 | Republic of Poland Government Bond, 6.00%, 25/10/2033 | 1.618.165 |
| 1.600.000 | Thames Water Utilities Finance Plc, 4.38%, 18/01/2031 | 1.588.106 |
| 1.517.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.40%, 28/03/2025 | 1.507.004 |
| 1.500.000 | Bundesobligation, 2.20%, 13/04/2028 | 1.494.810 |
| 1.380.000 | European Union, 3.25%, 04/07/2034 | 1.359.815 |
| 10.000.000 | Nykredit Realkredit AS, 4.00%, 01/10/2053 | 1.307.210 |
| 1.300.000 | Slovenia Government Bond, 1.19%, 14/03/2029 | 1.157.368 |
| 1.035.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.40%, 01/05/2033 | 1.057.642 |
| 1.000.000 | Morgan Stanley, 4.66%, 02/03/2029 | 1.000.000 |
| 1.000.000 | Toyota Motor Credit Corp, 4.05%, 13/09/2029 | 998.180 |
| 1.000.000 | VF Corp, 4.25%, 07/03/2029 | 995.700 |
| 1.001.000 | Spain Government Bond, 3.15%, 30/04/2033 | 995.528 |
| 1.000.000 | Intesa Sanpaolo SpA, 5.63%, 08/03/2033 | 992.540 |
| 946.000 | Slovakia Government Bond, 3.75%, 23/02/2035 | 931.867 |
| 7.000.000 | Nykredit Realkredit AS, 5.00%, 01/10/2053 | 930.745 |
| 905.093 | French Republic Government Bond OAT, 0.10%, 25/07/2031 | 891.591 |
| 865.312 | French Republic Government Bond OAT, 0.60%, 25/07/2034 | 861.736 |
| 800.000 | NatWest Group Plc, 5.76%, 28/02/2034 | 800.000 |
| 800.000 | JPMorgan Chase & Co, 4.46%, 13/11/2031 | 800.000 |

Euro Bond Absolute Return – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse EUR |
|-----------|--|------------|
| 1.747.988 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.40%, 26/05/2025 | 1.723.422 |
| 1.617.000 | Slovakia Government Bond, 4.00%, 19/10/2032 | 1.686.262 |
| 1.500.000 | Bundesobligation, 2.20%, 13/04/2028 | 1.476.343 |
| 1.618.457 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 1.65%, 16/07/2032 | 1.414.887 |
| 1.260.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.40%, 28/03/2025 | 1.259.252 |
| 8.917.955 | Nykredit Realkredit AS, 5.00%, 01/10/2053 | 1.202.599 |
| 1.200.000 | Thames Water Utilities Finance Plc, 4.38%, 18/01/2031 | 1.196.838 |
| 1.035.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.40%, 01/05/2033 | 1.056.701 |
| 1.000.000 | Morgan Stanley, 4.66%, 02/03/2029 | 1.005.551 |
| 1.000.000 | Toyota Motor Credit Corp, 4.05%, 13/09/2029 | 1.003.180 |
| 1.000.114 | European Union, 3.25%, 04/07/2034 | 1.002.709 |
| 1.000.000 | VF Corp, 4.25%, 07/03/2029 | 999.225 |
| 1.000.000 | Italy Buoni Ordinari del Tesoro BOT, 0.00%, 28/02/2023 | 997.780 |
| 1.000.000 | Intesa Sanpaolo SpA, 5.63%, 08/03/2033 | 988.250 |
| 1.001.000 | Spain Government Bond, 3.15%, 30/04/2033 | 982.751 |
| 950.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.75%, 30/05/2024 | 936.250 |
| 900.000 | Spain Government Bond, 3.55%, 31/10/2033 | 926.270 |
| 946.000 | Slovakia Government Bond, 3.75%, 23/02/2035 | 919.762 |
| 905.691 | French Republic Government Bond OAT, 0.10%, 25/07/2031 | 887.965 |
| 865.372 | French Republic Government Bond OAT, 0.60%, 25/07/2034 | 867.166 |

European High Yield Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten EUR |
|-----------|--|------------|
| 6.920.000 | Lorca Telecom Bondco SA, 4.00%, 18/09/2027 | 6.474.173 |
| 5.650.000 | Bellis Acquisition Co Plc, 3.25%, 16/02/2026 | 5.791.234 |
| 5.785.000 | Douglas GmbH, 6.00%, 08/04/2026 | 5.589.977 |
| 4.667.000 | Telecom Italia SpA, 7.88%, 31/07/2028 | 4.853.068 |
| 4.600.000 | EDP - Energias de Portugal SA, 5.94%, 23/04/2083 | 4.609.674 |
| 4.500.000 | Abertis Infraestructuras Finance BV, 3.25%, 29/12/2049 | 4.176.248 |
| 5.000.000 | Cellnex Telecom SA, 1.75%, 23/10/2030 | 4.133.710 |
| 3.850.000 | Mobico Group Plc, 4.25%, 29/12/2049 | 3.871.282 |
| 3.770.000 | Telecom Italia SpA, 4.00%, 11/04/2024 | 3.747.433 |
| 3.625.000 | Dana Financing Luxembourg Sarl, 8.50%, 15/07/2031 | 3.742.616 |
| 3.772.000 | Motion Finco Sarl, 7.38%, 15/06/2030 | 3.733.637 |
| 4.845.000 | Ziggo Bond Co BV, 3.38%, 28/02/2030 | 3.728.862 |
| 4.200.000 | Electricite de France SA, 2.63%, 29/12/2049 | 3.532.264 |
| 3.349.000 | IHO Verwaltungs GmbH, 8.75%, 15/05/2028 | 3.493.878 |
| 3.400.000 | Multiversity SRL, 8.20%, 30/10/2028 | 3.402.426 |
| 4.200.000 | CECONOMY AG, 1.75%, 24/06/2026 | 3.332.653 |
| 2.869.000 | Pinnacle Bidco Plc, 10.00%, 11/10/2028 | 3.300.604 |
| 3.165.000 | Forvia SE, 7.25%, 15/06/2026 | 3.292.684 |
| 3.350.000 | Birkenstock Financing Sarl, 5.25%, 30/04/2029 | 3.250.095 |
| 3.920.000 | UGI International LLC, 2.50%, 01/12/2029 | 3.241.242 |

European High Yield Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse EUR |
|-----------|---|------------|
| 1.350.000 | Sigma Holdco BV, 5.75%, 15/05/2026 | 1.129.720 |
| 1.010.000 | Ford Motor Credit Co LLC, 4.87%, 03/08/2027 | 1.037.856 |
| 930.000 | Ford Motor Credit Co LLC, 3.02%, 06/03/2024 | 919.340 |
| 900.000 | Deutsche Lufthansa AG, 3.00%, 29/05/2026 | 854.659 |
| 800.000 | ZF Finance GmbH, 3.00%, 21/09/2025 | 770.000 |
| 750.000 | thyssenkrupp AG, 2.88%, 22/02/2024 | 741.750 |
| 742.000 | Bormioli Pharma SpA, 8.81%, 15/05/2028 | 733.585 |
| 682.000 | Emerald Debt Merger Sub, 6.38%, 15/12/2030 | 678.011 |
| 794.000 | TI Automotive Finance Plc, 3.75%, 15/04/2029 | 666.678 |
| 655.000 | Adevinta ASA, 3.00%, 15/11/2027 | 624.479 |
| 640.000 | IQVIA Inc, 2.88%, 15/09/2025 | 619.200 |
| 560.000 | Marks & Spencer Plc, 3.75%, 19/05/2026 | 618.971 |
| 600.000 | Air France-KLM, 8.13%, 31/05/2028 | 608.766 |
| 605.000 | Clarios Global LP/Clarios US Finance Co, 4.38%, 15/05/2026 | 577.019 |
| 700.000 | Virgin Media Finance Plc, 3.75%, 15/07/2030 | 567.000 |
| 750.000 | Altice France Holding SA, 8.00%, 15/05/2027 | 563.517 |
| 590.000 | Kronos International Inc, 3.75%, 15/09/2025 | 556.413 |
| 515.000 | Stonegate Pub Co Financing 2019 Plc, 8.25%, 31/07/2025 | 553.115 |
| 545.000 | Motion Finco Sarl, 7.38%, 15/06/2030 | 534.781 |
| 500.000 | Azelis Finance, 5.75%, 15/03/2028 | 504.000 |
| 560.000 | Organon & Co/Organon Foreign Debt Co-Issuer BV, 2.88%, 30/04/2028 | 489.373 |
| 485.000 | Banjay Entertainment SASU, 7.00%, 01/05/2029 | 480.393 |
| 434.000 | AA Bond Co Ltd, 7.38%, 31/07/2029 | 473.516 |
| 467.000 | Telecom Italia SpA, 6.88%, 15/02/2028 | 464.217 |
| 455.000 | Benteler International Aktiengesellschaft, 9.38%, 15/05/2028 | 456.775 |

European Sustainable Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten EUR |
|---------|---------------------------------|------------|
| 31.155 | EssilorLuxottica SA | 5.448.372 |
| 12.350 | L'Oreal SA | 4.970.609 |
| 15.524 | Ferrari NV | 4.365.688 |
| 106.131 | Netcompany Group A/S | 3.765.527 |
| 113.197 | RELX Plc | 3.630.468 |
| 3.866 | Adyen NV | 3.561.611 |
| 37.526 | London Stock Exchange Group Plc | 3.430.593 |
| 29.036 | Reply SpA | 2.963.125 |
| 158.106 | CVS Group Plc | 2.791.927 |
| 22.801 | SolarEdge Technologies Inc | 2.455.008 |
| 104.083 | 3i Group Plc | 2.432.497 |
| 25.363 | Novo Nordisk A/S Class B | 2.351.128 |
| 19.559 | Nestle SA | 2.165.014 |
| 4.967 | Kering SA | 2.099.719 |
| 11.737 | Schneider Electric SE | 1.913.451 |
| 20.460 | DiaSorin SpA | 1.836.733 |
| 27.795 | Alfen NV | 1.808.505 |
| 44.988 | Cellnex Telecom SA | 1.699.696 |
| 2.495 | ASML Holding NV | 1.524.663 |
| 20.930 | Euronext NV | 1.328.834 |
| 46.671 | Zalando SE | 1.088.280 |

European Sustainable Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse EUR |
|---------|---------------------------------|------------|
| 383.962 | 3i Group Plc | 8.192.869 |
| 168.818 | Cellnex Telecom SA | 5.917.343 |
| 415.885 | Atlas Copco AB Class A | 5.531.330 |
| 124.114 | Dechra Pharmaceuticals Plc | 5.218.733 |
| 4.204 | Adyen NV | 4.653.124 |
| 44.399 | London Stock Exchange Group Plc | 4.338.578 |
| 77.311 | Amundi SA | 4.239.249 |
| 9.893 | Tecan Group AG | 3.719.134 |
| 6.894 | Kering SA | 3.717.234 |
| 125.353 | HelloFresh SE | 3.220.097 |
| 23.234 | Straumann Holding AG | 3.114.418 |
| 20.721 | Novo Nordisk A/S Class B | 3.044.428 |
| 48.121 | Scout24 SE | 2.856.903 |
| 2.732 | Partners Group Holding AG | 2.716.631 |
| 8.392 | Ferrari NV | 2.700.670 |
| 4.278 | ASML Holding NV | 2.687.019 |
| 6.929 | VAT Group AG | 2.539.139 |
| 23.095 | Nestle SA | 2.474.058 |
| 63.349 | Zalando SE | 2.447.794 |
| 10.483 | Sartorius Stedim Biotech | 2.370.875 |
| 99.974 | Assa Abloy AB Class B | 2.226.079 |
| 12.449 | Schneider Electric SE | 1.965.988 |
| 4.604 | L'Oreal SA | 1.890.375 |
| 26.254 | Euronext NV | 1.868.694 |
| 133.595 | TeamViewer SE | 1.865.266 |
| 33.931 | Alfen NV | 1.826.054 |
| 24.482 | Bakkafrost P/F | 1.411.152 |
| 54.979 | CVS Group Plc | 1.188.243 |
| 8.469 | Beiersdorf AG | 1.034.547 |

Event Driven – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|-----------|--|-------------|
| 8.650.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 31/08/2023 | 8.531.968 |
| 7.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 11/04/2024 | 6.874.668 |
| 7.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 04/01/2024 | 6.871.097 |
| 7.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 11/01/2024 | 6.863.872 |
| 7.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 18/01/2024 | 6.861.813 |
| 7.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 25/01/2024 | 6.859.285 |
| 6.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 19/03/2024 | 5.929.827 |
| 6.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 17/10/2023 | 5.898.845 |
| 6.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 30/04/2024 | 5.896.768 |
| 6.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 22/02/2024 | 5.863.303 |
| 6.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 21/03/2024 | 5.862.438 |
| 6.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 29/02/2024 | 5.857.170 |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 16/04/2024 | 4.916.311 |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 23/04/2024 | 4.914.056 |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 28/03/2024 | 4.902.589 |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 14/12/2023 | 4.902.022 |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 04/04/2024 | 4.897.902 |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 21/12/2023 | 4.896.923 |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 01/02/2024 | 4.893.096 |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 28/12/2023 | 4.891.991 |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 08/02/2024 | 4.888.129 |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 15/02/2024 | 4.883.122 |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 07/03/2024 | 4.880.739 |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 14/03/2024 | 4.880.390 |
| 4.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 01/08/2023 | 3.942.926 |
| 4.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 19/09/2023 | 3.941.188 |
| 4.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 24/08/2023 | 3.941.140 |
| 4.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 07/09/2023 | 3.940.881 |
| 4.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 10/08/2023 | 3.938.119 |
| 4.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 17/08/2023 | 3.937.768 |
| 4.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 14/09/2023 | 3.936.444 |
| 4.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 26/09/2023 | 3.935.935 |
| 4.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 24/10/2023 | 3.931.796 |
| 4.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 02/11/2023 | 3.927.229 |
| 4.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 30/11/2023 | 3.919.079 |
| 3.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 16/01/2024 | 2.978.079 |
| 3.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 09/01/2024 | 2.976.832 |
| 3.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 30/03/2023 | 2.969.995 |
| 3.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 27/06/2023 | 2.953.508 |
| 3.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 05/07/2023 | 2.951.640 |
| 3.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 20/07/2023 | 2.951.072 |
| 3.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 22/06/2023 | 2.950.704 |

Event Driven – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen: (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|-----------|--|-------------|
| 3.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 06/07/2023 | 2.949.845 |
| 3.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 10/10/2023 | 2.949.550 |
| 3.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 03/10/2023 | 2.948.704 |
| 3.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 29/06/2023 | 2.948.008 |
| 3.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 13/07/2023 | 2.946.934 |
| 3.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 09/11/2023 | 2.942.751 |
| 3.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 16/11/2023 | 2.942.705 |
| 3.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 24/11/2023 | 2.939.573 |
| 3.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 07/12/2023 | 2.939.309 |
| 2.800.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 06/04/2023 | 2.770.306 |
| 2.800.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 16/05/2023 | 2.758.322 |
| 2.800.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 23/05/2023 | 2.757.640 |
| 2.800.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 06/06/2023 | 2.757.591 |
| 2.800.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 13/06/2023 | 2.756.429 |
| 2.800.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 20/06/2023 | 2.755.893 |

Verkäufe insgesamt:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|---------|--------------------------|-------------|
| 18.900 | ARM Holdings Plc ADR | 1.060.290 |
| 19.059 | Kenvue Inc | 486.576 |
| 8.800 | Maplebear Inc | 369.600 |
| 4.736 | CAVA Group Inc | 198.912 |
| 6.315 | Nextracker Inc Class A | 191.408 |
| 4.000 | Klaviyo Inc | 147.000 |
| 5.912 | Savers Value Village Inc | 146.440 |
| 1.427 | ODDITY Tech Ltd Class A | 70.066 |
| 1.136 | ACELYRIN Inc | 26.128 |

Global Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|----------------|---|-------------|
| 4.746.920 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1.63%, 15/10/2027 | 4.834.558 |
| 2.595.000 | United States Treasury Note/Bond, 4.13%, 15/11/2032 | 2.727.196 |
| 2.500.000 | State of Hesse, 2.88%, 04/07/2033 | 2.725.318 |
| 3.580.000 | Canadian Government Bond, 3.00%, 01/11/2024 | 2.589.112 |
| 2.503.000 | United States Treasury Note/Bond, 3.50%, 31/01/2028 | 2.484.675 |
| 2.465.000 | United States Treasury Note/Bond, 3.38%, 15/05/2033 | 2.382.589 |
| 2.330.000 | United States Treasury Note/Bond, 3.50%, 15/02/2033 | 2.308.672 |
| 28.806.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 6.63%, 15/05/2033 | 1.940.961 |
| 1.670.000 | Land Berlin, 3.00%, 11/07/2031 | 1.807.568 |
| 1.500.000 | Gemeinsame Deutsche Bundesländer, 3.00%, 26/04/2030 | 1.631.447 |
| 1.630.000 | United States Treasury Note/Bond, 3.63%, 15/02/2053 | 1.590.895 |
| 1.505.000 | Fannie Mae Pool, 6.00%, 01/03/2054 | 1.524.545 |
| 1.130.000 | United Kingdom Gilt, 4.75%, 07/12/2030 | 1.505.629 |
| 1.320.000 | Bundesobligation, 2.40%, 19/10/2028 | 1.450.108 |
| 1.300.000 | State of Brandenburg, 3.00%, 20/07/2033 | 1.443.308 |
| 1.490.000 | United States Treasury Note/Bond, 3.88%, 15/08/2033 | 1.437.428 |
| 10.100.000 | Nykredit Realkredit AS, 4.00%, 01/10/2053 | 1.402.975 |
| 1.240.732 | United Kingdom Gilt, 3.75%, 22/10/2053 | 1.362.512 |
| 1.236.000 | Autonomous Community of Madrid Spain, 3.60%, 30/04/2033 | 1.359.268 |
| 1.360.000 | French Republic Government Bond OAT, 0.75%, 25/05/2028 | 1.308.191 |

Global Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|---------------|---|-------------|
| 11.488.000 | Canadian Government Bond, 3.00%, 01/11/2024 | 8.377.134 |
| 4.763.127 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1.63%, 15/10/2027 | 4.780.586 |
| 3.415.000 | United States Treasury Note/Bond, 4.13%, 15/11/2032 | 3.548.502 |
| 4.202.104 | Canadian Government Real Return Bond, 4.25%, 01/12/2026 | 3.423.689 |
| 60.445.000 | Mexican Bonos, 7.75%, 29/05/2031 | 3.130.791 |
| 3.161.300 | United States Treasury Note/Bond, 0.88%, 31/01/2024 | 3.040.981 |
| 4.033.410.000 | Korea Treasury Bond, 2.13%, 10/06/2027 | 2.816.413 |
| 2.503.000 | United States Treasury Note/Bond, 3.50%, 31/01/2028 | 2.436.170 |
| 1.749.840 | United Kingdom Inflation-Linked Gilt, 1.25%, 22/11/2032 | 2.415.414 |
| 2.465.000 | United States Treasury Note/Bond, 3.38%, 15/05/2033 | 2.362.083 |
| 2.330.000 | United States Treasury Note/Bond, 3.50%, 15/02/2033 | 2.322.107 |
| 2.054.000 | United States Treasury Note/Bond, 0.50%, 31/03/2025 | 1.903.713 |
| 250.650.000 | Japan Government Five Year Bond, 0.01%, 20/09/2026 | 1.698.799 |
| 1.505.000 | Fannie Mae Pool, 6.00%, 01/03/2054 | 1.520.318 |
| 1.630.000 | United States Treasury Note/Bond, 3.63%, 15/02/2053 | 1.517.698 |
| 1.490.000 | United States Treasury Note/Bond, 3.88%, 15/08/2033 | 1.417.378 |
| 1.395.573 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.25%, 15/02/2027 | 1.402.112 |
| 1.320.000 | Bundesobligation, 2.40%, 19/10/2028 | 1.396.371 |
| 1.150.000 | Mexico Government International Bond, 6.35%, 09/02/2035 | 1.185.038 |
| 1.145.000 | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/01/2054 | 1.161.758 |

Global Diversified Income FMP - 2024 – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|------------|--|-------------|
| 20.195.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 18/01/2024 | 19.866.577 |
| 5.200.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 21/12/2023 | 5.130.111 |
| 4.040.000 | Ball Corp, 4.00%, 15/11/2023 | 3.989.500 |
| 3.000.000 | HSBC Holdings Plc, 4.25%, 14/03/2024 | 2.954.520 |
| 3.000.000 | Nationwide Building Society, 0.55%, 22/01/2024 | 2.898.840 |
| 3.000.000 | Air Lease Corp, 0.70%, 15/02/2024 | 2.891.640 |
| 2.345.000 | Sprint LLC, 7.13%, 15/06/2024 | 2.400.694 |
| 2.200.000 | Energy Transfer LP, 3.90%, 15/05/2024 | 2.170.718 |
| 1.450.000 | MGM China Holdings Ltd, 5.38%, 15/05/2024 | 1.430.813 |
| 815.000 | NOVA Chemicals Corp, 4.88%, 01/06/2024 | 802.775 |
| 790.000 | Taylor Morrison Communities Inc/Taylor Morrison Holdings II Inc, 5.63%, 01/03/2024 | 787.038 |
| 500.000 | Shriram Finance Ltd, 4.40%, 13/03/2024 | 493.700 |
| 490.000 | Ford Motor Credit Co LLC, 5.58%, 18/03/2024 | 486.938 |
| 480.000 | FMG Resources August 2006 Pty Ltd, 5.13%, 15/05/2024 | 477.792 |
| 480.000 | EQM Midstream Partners LP, 4.75%, 15/07/2023 | 477.600 |
| 470.000 | Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc, 5.25%, 15/04/2024 | 467.063 |
| 400.000 | TRI Pointe Group Inc/TRI Pointe Homes Inc, 5.88%, 15/06/2024 | 399.500 |
| 400.000 | Starwood Property Trust Inc, 5.50%, 01/11/2023 | 399.000 |
| 400.000 | Hanesbrands Inc, 4.63%, 15/05/2024 | 394.900 |
| 390.000 | OneMain Finance Corp, 6.13%, 15/03/2024 | 387.563 |

Verkäufe insgesamt:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|-----------|--|-------------|
| 2.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 21/12/2023 | 1.976.977 |
| 1.385.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 18/01/2024 | 1.350.292 |
| 989.000 | Egypt Government International Bond, 6.20%, 01/03/2024 | 908.958 |
| 800.000 | REC Ltd, 3.50%, 12/12/2024 | 777.384 |
| 600.000 | ABJA Investment Co Pte Ltd, 5.95%, 31/07/2024 | 598.620 |
| 400.000 | Egypt Government International Bond, 4.55%, 20/11/2023 | 388.000 |
| 200.000 | Huarong Finance 2019 Co Ltd, 3.25%, 13/11/2024 | 186.400 |

Global Equity Megatrends – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|---------|-----------------------------------|-------------|
| 127.087 | ModivCare Inc | 5.610.039 |
| 247.528 | Element Solutions Inc | 4.635.045 |
| 55.745 | Alibaba Group Holding Ltd ADR | 4.584.254 |
| 170.383 | Criteo SA ADR | 4.528.475 |
| 112.847 | Uber Technologies Inc | 3.827.414 |
| 120.899 | Perrigo Co Plc | 3.766.792 |
| 41.428 | Amdocs Ltd | 3.679.875 |
| 168.904 | Gen Digital Inc | 3.335.826 |
| 99.034 | Corning Inc | 3.084.720 |
| 373.887 | Zeta Global Holdings Corp Class A | 3.020.088 |
| 60.798 | Stericycle Inc | 2.747.924 |
| 24.552 | Expedia Group Inc | 2.698.733 |
| 67.412 | Scholastic Corp | 2.505.049 |
| 598.469 | Pets at Home Group Plc | 2.450.236 |
| 11.826 | Nice Ltd ADR | 2.357.722 |
| 59.727 | Delta Air Lines Inc | 2.171.014 |
| 221.303 | Despegar.com Corp | 1.429.124 |
| 51.264 | Vistra Corp | 1.214.471 |
| 11.881 | Alphabet Inc Class A | 1.201.539 |
| 2.652 | TE Connectivity Ltd | 342.820 |

Global Equity Megatrends – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|---------|-----------------------------------|-------------|
| 16.228 | Quanta Services Inc | 3.096.215 |
| 9.013 | Aon Plc Class A | 2.791.492 |
| 204.763 | Paya Holdings Inc | 1.976.649 |
| 42.476 | Vistra Corp | 1.367.184 |
| 7.294 | Expedia Group Inc | 860.743 |
| 6.727 | Alibaba Group Holding Ltd ADR | 679.061 |
| 35.471 | Element Fleet Management Corp | 508.259 |
| 8.123 | Uber Technologies Inc | 413.271 |
| 9.941 | ATI Inc | 375.800 |
| 8.365 | Scholastic Corp | 348.301 |
| 2.371 | Alphabet Inc Class A | 277.216 |
| 9.059 | Criteo SA ADR | 251.642 |
| 2.495 | Amdocs Ltd | 223.005 |
| 43.067 | Pets at Home Group Plc | 191.972 |
| 1.204 | TE Connectivity Ltd | 153.714 |
| 3.948 | Perrigo Co Plc | 140.805 |
| 3.915 | Corning Inc | 135.746 |
| 13.256 | Zeta Global Holdings Corp Class A | 122.591 |
| 2.448 | ModivCare Inc | 114.716 |
| 5.488 | Element Solutions Inc | 104.863 |

Global Flexible Credit Income – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|-----------|--|-------------|
| 8.410.000 | United States Treasury Note/Bond, 3.38%, 15/05/2033 | 8.168.903 |
| 5.080.000 | United States Treasury Note/Bond, 3.88%, 15/05/2043 | 4.996.677 |
| 4.160.000 | American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd, 5.75%, 20/04/2029 | 4.067.595 |
| 3.740.000 | Ford Motor Credit Co LLC, 7.20%, 10/06/2030 | 3.858.986 |
| 3.530.000 | TransDigm Inc, 6.75%, 15/08/2028 | 3.582.244 |
| 3.516.000 | Comstock Resources Inc, 6.75%, 01/03/2029 | 3.174.156 |
| 2.515.000 | Bath & Body Works Inc, 6.63%, 01/10/2030 | 2.425.213 |
| 2.305.000 | ZF North America Capital Inc, 7.13%, 14/04/2030 | 2.378.425 |
| 1.905.000 | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC, 6.50%, 15/02/2028 | 1.910.081 |
| 1.795.000 | Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 1B1, 7.94%, 25/07/2030 | 1.873.531 |
| 1.850.000 | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer, 6.75%, 15/04/2028 | 1.850.933 |
| 1.930.000 | Iron Mountain Inc, 5.63%, 15/07/2032 | 1.770.775 |
| 1.930.000 | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp, 5.00%, 01/02/2028 | 1.770.445 |
| 1.985.000 | Macy's Retail Holdings LLC, 5.88%, 15/03/2030 | 1.764.006 |
| 1.775.000 | American Airlines Inc, 7.25%, 15/02/2028 | 1.755.894 |
| 1.935.000 | Energizer Holdings Inc, 4.75%, 15/06/2028 | 1.715.821 |
| 1.630.000 | Mauser Packaging Solutions Holding Co, 7.88%, 15/08/2026 | 1.628.988 |
| 1.630.000 | HUB International Ltd, 7.25%, 15/06/2030 | 1.627.089 |
| 1.620.000 | Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp, 8.25%, 31/12/2028 | 1.611.587 |
| 1.585.000 | Ford Motor Credit Co LLC, 6.95%, 06/03/2026 | 1.586.325 |

Global Flexible Credit Income – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|-----------|---|-------------|
| 8.410.000 | United States Treasury Note/Bond, 3.38%, 15/05/2033 | 7.812.482 |
| 4.990.000 | American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd, 5.50%, 20/04/2026 | 4.916.890 |
| 4.210.000 | Iron Mountain Inc, 5.63%, 15/07/2032 | 3.725.106 |
| 3.000.000 | Trinitas CLO XII Ltd Series 2020-12X Class D, 8.36%, 25/04/2033 | 2.817.300 |
| 2.985.000 | Ford Motor Credit Co LLC, 4.13%, 17/08/2027 | 2.749.616 |
| 3.350.000 | Occidental Petroleum Corp, 4.30%, 15/08/2039 | 2.613.772 |
| 2.305.000 | ZF North America Capital Inc, 7.13%, 14/04/2030 | 2.355.450 |
| 2.635.000 | AssuredPartners Inc, 5.63%, 15/01/2029 | 2.304.000 |
| 2.600.000 | WR Grace Holdings LLC, 5.63%, 15/08/2029 | 2.141.720 |
| 2.500.000 | Petroleos Mexicanos, 6.50%, 23/01/2029 | 2.138.675 |
| 2.530.000 | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp, 4.25%, 01/02/2031 | 2.106.225 |
| 1.795.000 | Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 1B1, 7.94%, 25/07/2030 | 1.913.919 |
| 2.000.000 | Dryden 93 CLO Ltd Series 2021-93X Class D, 8.53%, 15/01/2034 | 1.846.000 |
| 2.335.000 | Sirius XM Radio Inc, 3.88%, 01/09/2031 | 1.833.119 |
| 2.400.000 | Buckeye Partners LP, 5.85%, 15/11/2043 | 1.790.607 |
| 1.960.000 | SPX FLOW Inc, 8.75%, 01/04/2030 | 1.719.200 |
| 1.715.000 | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp, 8.00%, 15/01/2027 | 1.690.873 |
| 2.030.000 | CVS Health Corp, 5.05%, 25/03/2048 | 1.668.538 |
| 1.665.000 | Harvest Midstream I LP, 7.50%, 01/09/2028 | 1.646.800 |
| 1.700.000 | Sappi Papier Holding GmbH, 3.63%, 15/03/2028 | 1.635.390 |

Global High Yield SDG Engagement – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|-----------|---|-------------|
| 4.700.000 | American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd, 5.75%, 20/04/2029 | 4.453.139 |
| 3.970.000 | CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC, 5.50%, 15/06/2031 | 3.636.931 |
| 3.960.000 | 1011778 BC ULC/New Red Finance Inc, 4.00%, 15/10/2030 | 3.425.400 |
| 3.355.000 | Windsor Holdings III LLC, 8.50%, 15/06/2030 | 3.378.413 |
| 3.200.000 | Civitas Resources Inc, 8.63%, 01/11/2030 | 3.228.913 |
| 3.245.000 | Energizer Holdings Inc, 6.50%, 31/12/2027 | 3.176.677 |
| 3.680.000 | AthenaHealth Group Inc, 6.50%, 15/02/2030 | 3.145.098 |
| 3.050.000 | GTCR W-2 Merger Sub LLC, 7.50%, 15/01/2031 | 3.050.786 |
| 3.280.000 | Yum! Brands Inc, 3.63%, 15/03/2031 | 2.887.051 |
| 2.845.000 | NCL Corp Ltd, 8.13%, 15/01/2029 | 2.860.346 |
| 2.820.000 | Lorca Telecom Bondco SA, 4.00%, 18/09/2027 | 2.793.384 |
| 2.795.000 | Aramark Services Inc, 5.00%, 01/02/2028 | 2.650.560 |
| 2.740.000 | Molina Healthcare Inc, 4.38%, 15/06/2028 | 2.563.974 |
| 2.540.000 | First Quantum Minerals Ltd, 8.63%, 01/06/2031 | 2.523.000 |
| 2.500.000 | TransDigm Inc, 6.88%, 15/12/2030 | 2.508.293 |
| 2.330.000 | ZF North America Capital Inc, 7.13%, 14/04/2030 | 2.384.739 |
| 2.395.000 | IQVIA Inc, 5.00%, 15/10/2026 | 2.340.810 |
| 2.305.000 | HUB International Ltd, 7.25%, 15/06/2030 | 2.314.308 |
| 2.377.500 | American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd, 5.50%, 20/04/2026 | 2.309.185 |
| 2.155.000 | Ritchie Bros Holdings Inc, 7.75%, 15/03/2031 | 2.232.882 |

Global High Yield SDG Engagement – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|-----------|---|-------------|
| 3.605.000 | Iron Mountain Inc, 4.88%, 15/09/2027 | 3.333.767 |
| 2.955.000 | IQVIA Inc, 5.00%, 15/10/2026 | 2.866.670 |
| 2.771.000 | LeasePlan Corp NV, 7.38%, 29/12/2049 | 2.830.236 |
| 2.765.000 | Ford Motor Credit Co LLC, 4.69%, 09/06/2025 | 2.661.052 |
| 2.531.000 | Adevinta ASA, 2.63%, 15/11/2025 | 2.618.747 |
| 3.110.000 | CHS/Community Health Systems Inc, 6.00%, 15/01/2029 | 2.513.505 |
| 3.200.000 | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp, 4.50%, 01/06/2033 | 2.481.155 |
| 2.225.000 | First Quantum Minerals Ltd, 8.63%, 01/06/2031 | 2.238.923 |
| 2.710.000 | WR Grace Holdings LLC, 5.63%, 15/08/2029 | 2.197.567 |
| 2.225.000 | EQM Midstream Partners LP, 6.50%, 01/07/2027 | 2.163.992 |
| 2.545.000 | Yum! Brands Inc, 3.63%, 15/03/2031 | 2.155.825 |
| 2.175.000 | TransDigm Inc, 6.25%, 15/03/2026 | 2.153.778 |
| 1.861.000 | Marks & Spencer Plc, 3.75%, 19/05/2026 | 2.148.831 |
| 2.205.000 | IQVIA Inc, 2.88%, 15/06/2028 | 2.140.589 |
| 2.180.000 | American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd, 5.75%, 20/04/2029 | 2.091.095 |
| 2.225.000 | Aramark Services Inc, 5.00%, 01/02/2028 | 2.054.596 |
| 2.280.000 | CAB SELAS, 3.38%, 01/02/2028 | 2.030.284 |
| 2.005.000 | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp, 8.00%, 15/01/2027 | 1.963.249 |
| 1.830.000 | Occidental Petroleum Corp, 6.45%, 15/09/2036 | 1.881.373 |
| 2.095.000 | Sensata Technologies BV, 4.00%, 15/04/2029 | 1.846.698 |

Global High Yield Sustainable Action – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|---------|--|-------------|
| 190.000 | IQVIA Inc, 5.00%, 15/10/2026 | 184.465 |
| 135.000 | Avient Corp, 7.13%, 01/08/2030 | 136.349 |
| 140.000 | Energizer Holdings Inc, 6.50%, 31/12/2027 | 135.288 |
| 100.000 | Belden Inc, 3.38%, 15/07/2027 | 98.331 |
| 100.000 | eG Global Finance Plc, 4.38%, 07/02/2025 | 94.857 |
| 100.000 | Heimstaden Bostad AB, 3.25%, 29/12/2049 | 82.561 |
| 75.000 | Sprint Capital Corp, 6.88%, 15/11/2028 | 78.180 |
| 80.000 | Clean Harbors Inc, 4.88%, 15/07/2027 | 76.600 |
| 80.000 | Hologic Inc, 4.63%, 01/02/2028 | 76.401 |
| 75.000 | Berry Global Inc, 5.63%, 15/07/2027 | 72.938 |
| 70.000 | Mauser Packaging Solutions Holding Co, 7.88%, 15/08/2026 | 70.150 |
| 60.000 | TerraForm Power Operating LLC, 5.00%, 31/01/2028 | 56.586 |
| 55.000 | NortonLifeLock Inc, 6.19%, 12/09/2029 | 54.931 |
| 50.000 | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer, 6.75%, 15/04/2028 | 50.000 |
| 45.000 | Ford Motor Credit Co LLC, 6.95%, 06/03/2026 | 45.043 |
| 45.000 | Tenet Healthcare Corp, 6.75%, 15/05/2031 | 45.000 |
| 40.000 | United Rentals North America Inc, 6.00%, 15/12/2029 | 40.200 |
| 40.000 | Iron Mountain Inc, 5.25%, 15/03/2028 | 37.500 |
| 30.000 | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC, 6.50%, 15/02/2028 | 30.000 |
| 30.000 | United Rentals North America Inc, 5.50%, 15/05/2027 | 29.475 |
| 30.000 | Clean Harbors Inc, 5.13%, 15/07/2029 | 28.950 |
| 30.000 | CommScope Inc, 6.00%, 01/03/2026 | 28.875 |
| 30.000 | EnerSys, 4.38%, 15/12/2027 | 28.125 |
| 30.000 | CommScope Inc, 8.25%, 01/03/2027 | 26.475 |
| 25.000 | Centene Corp, 4.25%, 15/12/2027 | 23.890 |
| 25.000 | United Rentals North America Inc, 4.00%, 15/07/2030 | 22.202 |
| 25.000 | API Group DE Inc, 4.13%, 15/07/2029 | 21.656 |
| 20.000 | Ford Motor Credit Co LLC, 8.04%, 06/03/2026 | 20.075 |
| 20.000 | American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 7.25%, 15/02/2028 | 20.000 |
| 25.000 | Dana Inc, 4.50%, 15/02/2032 | 19.774 |
| 20.000 | ZF North America Inc, 4.75%, 29/04/2025 | 19.550 |
| 20.000 | Tenet Healthcare Corp, 4.88%, 01/01/2026 | 19.542 |

Global High Yield Sustainable Action – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|---------|--|-------------|
| 330.000 | Iron Mountain Inc, 5.25%, 15/03/2028 | 309.375 |
| 265.000 | IQVIA Inc, 5.00%, 15/10/2026 | 257.050 |
| 255.000 | TerraForm Power Operating LLC, 5.00%, 31/01/2028 | 241.375 |
| 255.000 | Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc, 6.25%, 15/01/2028 | 239.063 |
| 260.000 | Frontier Communications Holdings LLC, 5.88%, 15/10/2027 | 237.019 |
| 240.000 | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC, 5.88%, 15/02/2028 | 234.022 |
| 270.000 | OneMain Finance Corp, 3.50%, 15/01/2027 | 231.849 |
| 250.000 | AssuredPartners Inc, 5.63%, 15/01/2029 | 216.130 |
| 220.000 | Valvoline Inc, 4.25%, 15/02/2030 | 215.875 |
| 200.000 | Belden Inc, 3.38%, 15/07/2027 | 203.178 |
| 205.000 | Tenet Healthcare Corp, 4.88%, 01/01/2026 | 200.718 |
| 175.000 | SGL Carbon SE, 4.63%, 30/09/2024 | 187.588 |
| 185.000 | HCA Inc, 5.38%, 01/02/2025 | 184.375 |
| 220.000 | Vmed O2 UK Financing I Plc, 4.75%, 15/07/2031 | 184.108 |
| 210.000 | GYP Holdings III Corp, 4.63%, 01/05/2029 | 183.803 |
| 200.000 | ZF Finance GmbH, 2.25%, 03/05/2028 | 183.295 |
| 200.000 | Organon & Co/Organon Foreign Debt Co-Issuer BV, 5.13%, 30/04/2031 | 171.250 |
| 170.000 | APX Group Inc, 6.75%, 15/02/2027 | 167.300 |
| 175.000 | NextEra Energy Operating Partners LP, 4.50%, 15/09/2027 | 164.339 |
| 200.000 | VZ Secured Financing BV, 5.00%, 15/01/2032 | 163.262 |

Global Investment Grade Credit – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|-----------|---|-------------|
| 1.240.000 | United States Treasury Note/Bond, 3.88%, 15/05/2043 | 1.181.250 |
| 1.090.000 | WEC Energy Group Inc, 4.75%, 09/01/2026 | 1.088.736 |
| 1.000.000 | Daimler Truck Holding AG, 5.13%, 19/01/2028 | 999.350 |
| 900.000 | Thames Water Utilities Finance Plc, 4.38%, 18/01/2031 | 917.785 |
| 875.000 | United States Treasury Note/Bond, 3.75%, 15/04/2026 | 871.858 |
| 865.000 | European Union, 0.00%, 04/07/2029 | 788.624 |
| 723.000 | UBS Group AG, 3.25%, 02/04/2026 | 766.012 |
| 745.000 | Morgan Stanley, 5.12%, 01/02/2029 | 744.985 |
| 655.000 | Kenvue Inc, 5.00%, 22/03/2030 | 653.356 |
| 635.000 | United States Treasury Note/Bond, 4.38%, 15/12/2026 | 639.415 |
| 600.000 | Bayerische Landesbank, 7.00%, 05/01/2034 | 633.470 |
| 615.000 | Amgen Inc, 5.15%, 02/03/2028 | 613.930 |
| 610.000 | Intel Corp, 4.88%, 10/02/2028 | 609.494 |
| 605.000 | Nationwide Building Society, 6.56%, 18/10/2027 | 605.000 |
| 540.000 | Realty Income Corp, 5.13%, 06/07/2034 | 589.616 |
| 530.000 | European Union, 0.80%, 04/07/2025 | 553.956 |
| 545.000 | Enbridge Inc, 5.70%, 08/03/2033 | 546.752 |
| 500.000 | A1 Towers Holding GmbH, 5.25%, 13/07/2028 | 540.533 |
| 540.000 | Cox Communications Inc, 5.70%, 15/06/2033 | 540.232 |
| 535.000 | Coöperatieve Rabobank UA, 5.50%, 18/07/2025 | 534.652 |

Global Investment Grade Credit – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|-----------|--|-------------|
| 2.865.000 | United States Treasury Note/Bond, 2.63%, 15/04/2025 | 2.778.854 |
| 1.240.000 | United States Treasury Note/Bond, 3.88%, 15/05/2043 | 1.119.539 |
| 1.000.000 | Daimler Truck Holding AG, 5.13%, 19/01/2028 | 1.001.590 |
| 1.000.000 | AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 4.50%, 15/09/2023 | 995.150 |
| 1.000.000 | Bank of Montreal, 4.34%, 05/10/2028 | 990.375 |
| 1.000.000 | Westpac Banking Corp, 2.89%, 04/02/2030 | 936.565 |
| 1.000.000 | NatWest Group Plc, 3.07%, 22/05/2028 | 898.210 |
| 1.000.000 | Vontier Corp, 1.80%, 01/04/2026 | 894.620 |
| 900.000 | Anglo American Capital Plc, 3.63%, 11/09/2024 | 876.609 |
| 875.000 | United States Treasury Note/Bond, 3.75%, 15/04/2026 | 862.727 |
| 850.000 | Bank of America Corp, 1.95%, 27/10/2026 | 860.746 |
| 865.000 | European Union, 0.00%, 04/07/2029 | 788.608 |
| 800.000 | UBS Group AG, 1.01%, 30/07/2024 | 782.984 |
| 800.000 | Berry Global Inc, 0.95%, 15/02/2024 | 774.866 |
| 800.000 | Air Lease Corp, 0.70%, 15/02/2024 | 769.513 |
| 904.000 | UBS Group AG, 0.65%, 14/01/2028 | 763.813 |
| 750.000 | Diamondback Energy Inc, 6.25%, 15/03/2033 | 761.779 |
| 755.000 | Baker Hughes Holdings LLC/Baker Hughes Co-Obligor Inc, 2.06%, 15/12/2026 | 679.523 |
| 700.000 | Volkswagen International Finance NV, 3.88%, 29/12/2049 | 679.484 |
| 685.000 | MPLX LP, 4.00%, 15/03/2028 | 645.695 |

Global Opportunistic Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|----------------|---|-------------|
| 2.363.000 | United States Treasury Note/Bond, 3.00%, 31/07/2024 | 2.314.363 |
| 1.883.000 | United States Treasury Note/Bond, 3.88%, 31/03/2025 | 1.878.446 |
| 1.776.000 | United States Treasury Note/Bond, 4.13%, 31/01/2025 | 1.773.370 |
| 29.200.000 | Mexican Bonos, 7.50%, 26/05/2033 | 1.502.098 |
| 18.973.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 7.00%, 15/02/2033 | 1.274.961 |
| 1.190.000 | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/02/2054 | 1.207.071 |
| 1.220.000 | Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/02/2054 | 1.193.998 |
| 1.110.000 | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/06/2054 | 1.114.734 |
| 911.000 | United Kingdom Gilt, 3.25%, 31/01/2033 | 1.106.990 |
| 7.850.000 | China Government Bond, 2.62%, 25/06/2030 | 1.081.690 |
| 7.100.000 | China Government Bond, 2.88%, 25/02/2033 | 1.033.856 |
| 995.000 | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/03/2054 | 1.002.996 |
| 1.050.000 | Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/02/2053 | 992.127 |
| 860.000 | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/05/2054 | 871.740 |
| 870.000 | Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/02/2054 | 870.102 |
| 867.000 | United States Treasury Note/Bond, 4.00%, 30/06/2028 | 868.324 |
| 729.000 | European Union, 3.25%, 04/07/2034 | 824.581 |
| 795.000 | Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/03/2043 | 791.913 |
| 795.000 | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/04/2054 | 790.770 |
| 798.000 | United States Treasury Note/Bond, 3.00%, 30/06/2024 | 781.575 |

Global Opportunistic Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|------------|--|-------------|
| 3.433.000 | United States Treasury Note/Bond, 3.00%, 31/07/2024 | 3.356.504 |
| 1.883.000 | United States Treasury Note/Bond, 3.88%, 31/03/2025 | 1.863.690 |
| 1.776.000 | United States Treasury Note/Bond, 4.13%, 31/01/2025 | 1.756.043 |
| 200.000 | Neuberger Berman Global Investment Grade Credit Fund | 1.724.000 |
| 10.180.000 | China Government Bond, 2.56%, 21/10/2023 | 1.512.738 |
| 1.190.000 | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/01/2054 | 1.207.768 |
| 1.220.000 | Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/02/2054 | 1.204.947 |
| 1.190.000 | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/02/2054 | 1.203.596 |
| 1.240.000 | United States Treasury Note/Bond, 3.25%, 30/06/2027 | 1.203.529 |
| 1.110.000 | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/06/2054 | 1.114.734 |
| 911.000 | United Kingdom Gilt, 3.25%, 31/01/2033 | 1.047.024 |
| 1.050.000 | Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/02/2053 | 1.020.540 |
| 995.000 | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/03/2054 | 990.425 |
| 870.000 | Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/01/2054 | 870.374 |
| 860.000 | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/05/2054 | 868.539 |
| 870.000 | Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/02/2054 | 867.446 |
| 867.000 | United States Treasury Note/Bond, 4.00%, 30/06/2028 | 855.829 |
| 5.490.000 | China Government Bond, 2.26%, 24/02/2025 | 810.053 |
| 795.000 | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/04/2054 | 806.424 |
| 1.326.000 | New Zealand Government Bond, 3.50%, 14/04/2033 | 791.168 |

Global Real Estate Securities – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|---------|-------------------------------------|-------------|
| 1.296 | Equinix Inc | 969.764 |
| 382 | Nippon Prologis REIT Inc | 879.165 |
| 762 | GLP J-REIT | 867.146 |
| 33.800 | Nomura Real Estate Holdings Inc | 740.164 |
| 215.869 | Grainger Plc | 674.628 |
| 568.000 | Sino Land Co Ltd | 659.827 |
| 20.511 | VICI Properties Inc Class A | 655.195 |
| 2.049 | Public Storage | 577.885 |
| 39.000 | Sun Hung Kai Properties Ltd | 536.577 |
| 59.786 | Merlin Properties Socimi SA | 535.903 |
| 312.052 | Region RE Ltd | 525.819 |
| 10.958 | Shurgard Self Storage Ltd | 496.808 |
| 7.547 | Realty Income Corp | 477.038 |
| 69.545 | Hudson Pacific Properties Inc | 433.544 |
| 93 | Nippon Building Fund Inc | 385.982 |
| 130.720 | GPT Group | 382.885 |
| 2.211 | EastGroup Properties Inc | 358.568 |
| 1.901 | American Tower Corp | 353.250 |
| 2.470 | Crown Castle Inc | 317.474 |
| 2.811 | Simon Property Group Inc | 309.825 |
| 10.184 | Weyerhaeuser Co | 298.572 |
| 9.004 | Omega Healthcare Investors Inc | 286.888 |
| 14.402 | Kimco Realty Corp | 280.613 |
| 7.426 | Canadian Apartment Properties REIT | 272.016 |
| 1.564 | AvalonBay Communities Inc | 270.414 |
| 3.416 | Unibail-Rodamco-Westfield | 258.077 |
| 15.109 | RioCan Real Estate Investment Trust | 247.472 |
| 1.849 | Sun Communities Inc | 238.762 |
| 4.283 | Boston Properties Inc | 233.238 |
| 3.487 | Equity LifeStyle Properties Inc | 228.368 |
| 1.890 | PSP Swiss Property AG | 224.805 |
| 2.436 | Swiss Prime Site AG | 223.873 |
| 879 | SBA Communications Corp Class A | 218.286 |
| 14.329 | Urban Edge Properties | 215.474 |
| 23.690 | Tricon Residential Inc | 202.665 |
| 3.893 | Iron Mountain Inc | 201.606 |
| 31.600 | Link REIT | 199.972 |

Global Real Estate Securities – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|---------|-------------------------------------|-------------|
| 12.119 | Prologis Inc | 1.417.216 |
| 5.961 | American Tower Corp | 1.146.374 |
| 3.904 | Public Storage | 1.072.659 |
| 1.421 | Equinix Inc | 1.062.033 |
| 42.200 | Mitsui Fudosan Co Ltd | 917.513 |
| 246 | Mitsui Fudosan Logistics Park Inc | 915.095 |
| 11.400 | Welltower Inc | 904.276 |
| 50.173 | Summit Industrial Income REIT | 868.371 |
| 762 | GLP J-REIT | 867.092 |
| 65.900 | Mitsubishi Estate Co Ltd | 790.819 |
| 20.209 | Cellnex Telecom SA | 777.207 |
| 7.790 | Digital Realty Trust Inc | 740.763 |
| 6.658 | Crown Castle Inc | 724.535 |
| 12.963 | Realty Income Corp | 700.685 |
| 144.000 | China Resources Land Ltd | 694.462 |
| 69.225 | Segro Plc | 674.118 |
| 57.000 | Sun Hung Kai Properties Ltd | 663.522 |
| 60.156 | Safestore Holdings Plc | 635.563 |
| 10.508 | Iron Mountain Inc | 634.341 |
| 113.500 | CK Asset Holdings Ltd | 618.624 |
| 25.200 | Nomura Real Estate Holdings Inc | 585.091 |
| 122.500 | UOL Group Ltd | 573.724 |
| 28.847 | Kimco Realty Corp | 568.800 |
| 18.023 | VICI Properties Inc Class A | 536.557 |
| 15.643 | Invitation Homes Inc | 518.416 |
| 343.636 | Region RE Ltd | 499.352 |
| 4.132 | Simon Property Group Inc | 490.581 |
| 41.436 | UNITE Group Plc | 475.184 |
| 79.000 | Wharf Real Estate Investment Co Ltd | 462.690 |
| 3.636 | Sun Communities Inc | 461.738 |
| 6.723 | Equity LifeStyle Properties Inc | 446.856 |
| 78.273 | Great Portland Estates Plc | 440.113 |
| 10.648 | UDR Inc | 434.700 |
| 1.959 | Essex Property Trust Inc | 429.812 |
| 10.872 | Spirit Realty Capital Inc | 427.847 |
| 55.841 | Land Securities Group Plc | 418.797 |
| 6.924 | Equity Residential | 409.875 |
| 390 | LaSalle Logiport REIT | 407.505 |
| 29.647 | RioCan Real Estate Investment Trust | 407.143 |
| 3.133 | Extra Space Storage Inc | 403.270 |
| 20.426 | Healthpeak Properties Inc | 402.782 |
| 8.712 | Ventas Inc | 396.104 |

Global Real Estate Securities – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen (Fortsetzung):

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|---------|-------------------------------|-------------|
| 12.422 | Weyerhaeuser Co | 388.018 |
| 10.971 | American Homes 4 Rent Class A | 385.597 |
| 3.582 | Gecina SA | 384.641 |
| 6.245 | Boston Properties Inc | 360.164 |

Global Sustainable Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|---------|------------------------------|-------------|
| 10.237 | Synopsys Inc | 3.925.844 |
| 38.518 | Starbucks Corp | 3.924.307 |
| 18.388 | Schneider Electric SE | 3.279.923 |
| 9.415 | Microsoft Corp | 2.699.319 |
| 6.024 | L'Oreal SA | 2.513.907 |
| 19.910 | Nestle SA | 2.363.253 |
| 14.737 | SolarEdge Technologies Inc | 2.172.628 |
| 2.006 | Adyen NV | 2.009.655 |
| 10.092 | Estee Lauder Cos Inc Class A | 1.939.726 |
| 3.759 | UnitedHealth Group Inc | 1.865.063 |
| 24.467 | Alfen NV | 1.777.136 |
| 3.574 | VAT Group AG | 1.149.278 |
| 6.931 | Straumann Holding AG | 926.718 |
| 5.205 | Zoetis Inc Class A | 895.219 |
| 7.585 | NIKE Inc Class B | 837.865 |
| 23.500 | Recruit Holdings Co Ltd | 785.558 |
| 9.822 | Bakkafrost P/F | 606.006 |
| 1.114 | Thermo Fisher Scientific Inc | 603.220 |
| 1.453 | Adobe Inc | 581.320 |
| 2.339 | Visa Inc Class A | 579.033 |
| 1.409 | Mastercard Inc Class A | 561.006 |
| 4.401 | Amazon.com Inc | 516.423 |
| 22.510 | Assa Abloy AB Class B | 511.030 |
| 3.997 | Alphabet Inc Class A | 453.829 |
| 1.161 | Netflix Inc | 445.908 |
| 4.219 | Abbott Laboratories | 444.995 |
| 896 | Elevance Health Inc | 432.111 |

Global Sustainable Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|---------|------------------------------|-------------|
| 5.872 | Adobe Inc | 3.041.013 |
| 23.550 | Amazon.com Inc | 3.013.803 |
| 21.773 | Alphabet Inc Class A | 2.698.648 |
| 7.386 | S&P Global Inc | 2.569.456 |
| 113.699 | 3i Group Plc | 2.559.115 |
| 2.054 | Adyen NV | 2.501.000 |
| 4.292 | UnitedHealth Group Inc | 2.282.312 |
| 4.318 | Synopsys Inc | 2.118.699 |
| 12.719 | Marsh & McLennan Cos Inc | 1.995.110 |
| 6.062 | Microsoft Corp | 1.994.391 |
| 16.014 | Applied Materials Inc | 1.942.814 |
| 5.474 | Moody's Corp | 1.719.121 |
| 100.384 | TeamViewer SE | 1.650.905 |
| 3.013 | Intuit Inc | 1.619.135 |
| 48.018 | Match Group Inc | 1.520.248 |
| 22.234 | Brown & Brown Inc | 1.340.494 |
| 3.101 | Netflix Inc | 1.155.900 |
| 71.862 | Atlas Copco AB Class A | 1.095.433 |
| 15.836 | Alfen NV | 1.076.600 |
| 15.775 | Nasdaq Inc | 852.060 |
| 1.662 | Thermo Fisher Scientific Inc | 850.891 |
| 3.455 | Nordson Corp | 806.312 |
| 1.086 | ASML Holding NV | 755.052 |
| 23.720 | HelloFresh SE | 745.349 |
| 544 | Partners Group Holding AG | 622.168 |
| 5.681 | Novo Nordisk A/S Class B | 552.333 |
| 2.240 | Danaher Corp | 519.900 |
| 4.243 | NIKE Inc Class B | 511.435 |

Global Sustainable Value – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|---------|--|-------------|
| 31.777 | Shell Plc | 941.783 |
| 2.963 | Caterpillar Inc | 792.813 |
| 2.501 | Home Depot Inc | 781.994 |
| 52.066 | Iberdrola SA | 671.018 |
| 9.309 | Hartford Financial Services Group Inc | 665.162 |
| 4.431 | Ferguson Plc | 655.772 |
| 5.331 | Simon Property Group Inc | 612.074 |
| 9.549 | Occidental Petroleum Corp | 581.855 |
| 5.338 | Merck & Co Inc | 580.823 |
| 7.888 | PulteGroup Inc | 577.369 |
| 4.667 | Expeditors International of Washington Inc | 538.410 |
| 13.573 | Comcast Corp Class A | 537.319 |
| 7.821 | TotalEnergies SE | 476.748 |
| 14.938 | Fox Corp Class B | 463.253 |
| 14.370 | CSX Corp | 459.580 |
| 2.744 | Johnson & Johnson | 453.590 |
| 1.990 | Meta Platforms Inc Class A | 447.516 |
| 512 | Broadcom Inc | 444.318 |
| 22.569 | Manulife Financial Corp | 437.628 |
| 813 | Humana Inc | 404.569 |

Global Sustainable Value – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|---------|------------------------------------|-------------|
| 5.120 | Marathon Petroleum Corp | 748.193 |
| 42.874 | AT&T Inc | 637.508 |
| 9.946 | Bristol-Myers Squibb Co | 623.887 |
| 4.767 | Valero Energy Corp | 599.851 |
| 1.663 | Goldman Sachs Group Inc | 546.268 |
| 8.224 | ONEOK Inc | 543.222 |
| 2.945 | Apple Inc | 541.221 |
| 5.437 | Phillips 66 | 525.627 |
| 14.370 | Anglo American Plc | 498.596 |
| 1.661 | Meta Platforms Inc Class A | 490.135 |
| 15.483 | Pembina Pipeline Corp | 488.764 |
| 941 | UnitedHealth Group Inc | 482.671 |
| 2.767 | Cheniere Energy Inc | 472.975 |
| 1.617 | Microsoft Corp | 460.145 |
| 12.131 | Enbridge Inc | 457.088 |
| 8.907 | CRH Plc | 439.316 |
| 975 | United Rentals Inc | 432.718 |
| 6.314 | General Mills Inc | 424.620 |
| 53.489 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA | 415.165 |
| 3.163 | Alphabet Inc Class A | 405.973 |

High Yield Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|------------|--|-------------|
| 41.090.000 | United States Treasury Note/Bond, 5.00%, 31/08/2025 | 40.949.148 |
| 16.610.000 | TransDigm Inc, 6.75%, 15/08/2028 | 16.741.731 |
| 16.110.000 | First Quantum Minerals Ltd, 8.63%, 01/06/2031 | 16.005.675 |
| 14.540.000 | Mauser Packaging Solutions Holding Co, 7.88%, 15/08/2026 | 14.559.843 |
| 14.275.000 | Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC, 10.50%, 15/02/2028 | 14.283.163 |
| 13.730.000 | HUB International Ltd, 7.25%, 15/06/2030 | 13.741.224 |
| 13.660.000 | EquipmentShare.com Inc, 9.00%, 15/05/2028 | 13.172.054 |
| 12.660.000 | Ritchie Bros Holdings Inc, 7.75%, 15/03/2031 | 12.975.096 |
| 12.965.000 | Regal Rexnord Corp, 6.40%, 15/04/2033 | 12.873.866 |
| 12.165.000 | Civitas Resources Inc, 8.63%, 01/11/2030 | 12.198.925 |
| 11.075.000 | Mauser Packaging Solutions Holding Co, 9.25%, 15/04/2027 | 10.469.485 |
| 10.055.000 | Tenet Healthcare Corp, 6.75%, 15/05/2031 | 10.052.078 |
| 10.220.000 | Pilgrim's Pride Corp, 6.25%, 01/07/2033 | 10.040.402 |
| 11.455.000 | AthenaHealth Group Inc, 6.50%, 15/02/2030 | 9.878.354 |
| 11.150.000 | Caesars Entertainment Inc, 4.63%, 15/10/2029 | 9.753.413 |
| 9.710.000 | Ford Motor Credit Co LLC, 6.95%, 06/03/2026 | 9.718.100 |
| 9.655.000 | Churchill Downs Inc, 6.75%, 01/05/2031 | 9.655.000 |
| 10.790.000 | CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC, 5.50%, 15/06/2031 | 9.515.184 |
| 8.720.000 | NRG Energy Inc, 10.25%, 29/12/2049 | 8.780.471 |
| 8.765.000 | Petco Animal Supplies Inc, 0.00%, 03/03/2028 | 8.740.386 |

High Yield Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|------------|---|-------------|
| 21.780.000 | OneMain Finance Corp, 3.50%, 15/01/2027 | 18.526.100 |
| 20.615.000 | Global Aircraft Leasing Co Ltd, 6.50%, 15/09/2024 | 18.438.058 |
| 19.565.000 | MPH Acquisition Holdings LLC, 5.75%, 01/11/2028 | 13.791.774 |
| 21.825.000 | Level 3 Financing Inc, 4.63%, 15/09/2027 | 13.479.925 |
| 13.405.417 | American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd, 5.50%, 20/04/2026 | 13.095.723 |
| 12.460.000 | First Quantum Minerals Ltd, 8.63%, 01/06/2031 | 12.550.838 |
| 14.420.000 | Medline Borrower LP, 5.25%, 01/10/2029 | 12.105.286 |
| 11.745.000 | Occidental Petroleum Corp, 6.13%, 01/01/2031 | 11.913.050 |
| 23.200.000 | CSC Holdings LLC, 5.75%, 15/01/2030 | 11.860.105 |
| 15.931.000 | Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp, 5.75%, 15/01/2029 | 11.625.321 |
| 11.300.000 | Harvest Midstream I LP, 7.50%, 01/09/2028 | 11.059.510 |
| 12.010.000 | Sirius XM Radio Inc, 5.00%, 01/08/2027 | 11.052.794 |
| 10.765.000 | Regal Rexnord Corp, 6.40%, 15/04/2033 | 10.735.554 |
| 15.109.000 | Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp, 5.25%, 15/04/2030 | 10.363.409 |
| 11.130.000 | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer, 6.75%, 15/10/2027 | 10.355.631 |
| 9.190.000 | Occidental Petroleum Corp, 7.50%, 01/05/2031 | 10.102.527 |
| 10.460.000 | Presidio Holdings Inc, 8.25%, 01/02/2028 | 9.950.727 |
| 11.030.000 | Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc, 4.13%, 15/08/2026 | 9.839.756 |
| 9.710.000 | Ford Motor Credit Co LLC, 6.95%, 06/03/2026 | 9.785.475 |
| 11.150.000 | Caesars Entertainment Inc, 4.63%, 15/10/2029 | 9.626.864 |

InnovAsia 5G – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|---------|---|-------------|
| 62.000 | Novatek Microelectronics Corp | 924.830 |
| 8.200 | Socionext Inc | 853.774 |
| 8.300 | Shibaura Mechatronics Corp | 842.841 |
| 39.400 | Mercari Inc | 841.511 |
| 10.900 | Rohm Co Ltd | 743.867 |
| 10.200 | Enplas Corp | 721.709 |
| 13.165 | HAESUNG DS Co Ltd | 696.907 |
| 122.000 | Unimicron Technology Corp | 691.647 |
| 147.200 | Zhejiang Sanhua Intelligent Controls Co Ltd Class A | 570.442 |
| 167.000 | Gold Circuit Electronics Ltd | 553.086 |
| 165.000 | Lite-On Technology Corp | 543.953 |
| 8.444 | Polycab India Ltd | 542.678 |
| 17.000 | JMDC Inc | 541.829 |
| 17.800 | Harmonic Drive Systems Inc | 530.622 |
| 27.650 | Baidu Inc Class A | 516.805 |
| 70.330 | Shenzhen Sinexcel Electric Co Ltd Class A | 512.458 |
| 6.188 | JYP Entertainment Corp | 500.266 |
| 43.141 | Bharti Airtel Ltd | 476.373 |
| 16.900 | Nitto Boseki Co Ltd | 460.908 |
| 73.000 | E Ink Holdings Inc | 456.533 |
| 561.649 | Zomato Ltd | 443.256 |
| 124.400 | Longshine Technology Group Co Ltd Class A | 438.288 |
| 38.900 | Sansan Inc | 431.010 |
| 800 | SMC Corp | 430.293 |
| 274.000 | KCE Electronics PCL | 425.450 |
| 26.000 | Jentech Precision Industrial Co Ltd | 424.950 |
| 5.485 | SK Hynix Inc | 422.308 |
| 105.000 | Taiwan Union Technology Corp | 420.581 |
| 135.000 | Vanguard International Semiconductor Corp | 411.633 |
| 272.000 | Inventec Corp | 402.065 |
| 95.000 | Tripod Technology Corp | 396.856 |
| 8.700 | Square Enix Holdings Co Ltd | 391.852 |
| 261.000 | United Microelectronics Corp | 389.624 |
| 31.000 | ASUSTeK Computer Inc | 373.606 |
| 6.000 | Global Unichip Corp | 350.061 |
| 118.000 | Wistron Corp | 349.620 |
| 29.000 | Faraday Technology Corp | 349.389 |
| 315.000 | Compal Electronics Inc | 343.240 |
| 14.157 | Hanmi Semiconductor Co Ltd | 339.922 |
| 14.000 | WinWay Technology Co Ltd | 330.765 |
| 54.000 | Win Semiconductors Corp | 327.942 |
| 2.338 | LEENO Industrial Inc | 326.024 |
| 38.951 | One 97 Communications Ltd | 325.761 |
| 15.243 | Kanzhun Ltd ADR | 324.331 |

InnovAsia 5G – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen: (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|---------|---|-------------|
| 1.563 | LG Innotek Co Ltd | 318.160 |
| 187.600 | Hana Microelectronics PCL | 317.570 |
| 22.442 | Tech Mahindra Ltd | 317.316 |
| 5.000 | eMemory Technology Inc | 306.957 |
| 10.000 | Parade Technologies Ltd | 300.425 |
| 5.757 | New Oriental Education & Technology Group Inc ADR | 299.091 |
| 13.609 | HPSP Co Ltd | 286.577 |
| 2.374 | Fabrinet | 283.288 |
| 13.300 | Meituan Class B | 278.258 |

InnovAsia 5G – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|---------|---|-------------|
| 13.900 | Socionext Inc | 1.692.150 |
| 194.000 | Unimicron Technology Corp | 1.038.775 |
| 167.000 | Gold Circuit Electronics Ltd | 926.757 |
| 136.000 | E Ink Holdings Inc | 768.247 |
| 11.382 | New Oriental Education & Technology Group Inc ADR | 659.528 |
| 17.600 | Square Enix Holdings Co Ltd | 652.122 |
| 165.000 | Lite-On Technology Corp | 645.923 |
| 10.817 | Rambus Inc | 640.086 |
| 50.500 | Sansan Inc | 617.939 |
| 211.200 | Longshine Technology Group Co Ltd Class A | 602.195 |
| 35.000 | Yageo Corp | 590.522 |
| 95.000 | Tripod Technology Corp | 550.061 |
| 272.000 | Inventec Corp | 541.054 |
| 8.000 | eMemory Technology Inc | 506.192 |
| 9.849 | Beijing Kingsoft Office Software Inc Class A | 491.007 |
| 103.000 | Hongfa Technology Co Ltd Class A | 467.804 |
| 36.000 | Silergy Corp | 453.814 |
| 33.000 | Accton Technology Corp | 434.194 |
| 27.650 | Baidu Inc Class A | 429.820 |
| 15.851 | Beijing Huafeng Test & Control Technology Co Ltd Class A | 427.523 |
| 22.800 | Meituan Class B | 426.012 |
| 104.700 | Zhejiang Jiemei Electronic & Technology Co Ltd Class A | 422.650 |
| 48.800 | CyberAgent Inc | 419.078 |
| 2.246 | LG Innotek Co Ltd | 413.976 |
| 261.000 | United Microelectronics Corp | 411.592 |
| 21.000 | Jentech Precision Industrial Co Ltd | 404.046 |
| 135.000 | Vanguard International Semiconductor Corp | 393.762 |
| 9.900 | JMDC Inc | 359.053 |
| 2.400 | Shibaura Mechatronics Corp | 347.333 |
| 55.000 | Elite Material Co Ltd | 342.317 |
| 31.000 | ASUSTeK Computer Inc | 333.128 |
| 1.400 | Disco Corp | 326.673 |
| 54.000 | Win Semiconductors Corp | 303.454 |
| 38.951 | One 97 Communications Ltd | 302.880 |
| 6.700 | Hamamatsu Photonics KK | 299.261 |
| 10.000 | Parade Technologies Ltd | 296.429 |
| 46.000 | Chroma ATE Inc | 289.971 |
| 315.000 | Compal Electronics Inc | 285.239 |
| 30.150 | Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co Ltd Class A | 283.174 |
| 17.409 | Kanzhun Ltd ADR | 278.253 |
| 20.000 | Novatek Microelectronics Corp | 276.416 |
| 13.200 | Dexerials Corp | 267.552 |
| 1.655 | Fabrinet | 266.875 |
| 6.400 | Rohm Co Ltd | 252.457 |
| 14.600 | Furukawa Electric Co Ltd | 241.549 |

Japan Equity Engagement – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten JPY |
|---------|-------------------------------------|---------------|
| 257.200 | FP Partner Inc | 1.103.442.435 |
| 129.000 | JSB Co Ltd | 612.071.844 |
| 501.700 | Ricoh Co Ltd | 575.956.575 |
| 353.000 | Amada Co Ltd | 521.878.485 |
| 193.000 | Kosaido Holdings Co Ltd | 486.611.522 |
| 186.000 | Daiei Kankyo Co Ltd | 395.607.462 |
| 43.000 | Osaka Soda Co Ltd | 376.224.041 |
| 360.100 | TRYT Inc | 372.524.347 |
| 52.000 | Tokyo Seimitsu Co Ltd | 368.553.962 |
| 63.000 | Keisei Electric Railway Co Ltd | 364.716.800 |
| 66.000 | Zenkoku Hoshu Co Ltd | 344.790.254 |
| 98.000 | Asics Corp | 342.360.783 |
| 133.000 | TBS Holdings Inc | 325.152.885 |
| 166.500 | Transaction Co Ltd | 286.861.480 |
| 135.600 | Kansai Paint Co Ltd | 283.682.120 |
| 195.000 | Yamanashi Chuo Bank Ltd | 281.807.336 |
| 57.000 | San-A Co Ltd | 268.518.297 |
| 32.000 | ABC-Mart Inc | 254.399.313 |
| 68.400 | St Cousair Co Ltd | 230.426.291 |
| 102.100 | Pasona Group Inc | 222.877.022 |
| 121.700 | Genda Inc | 221.917.800 |
| 73.000 | Okinawa Cellular Telephone Co | 219.955.163 |
| 99.000 | Open Up Group Inc | 214.688.510 |
| 103.000 | Menicon Co Ltd | 202.150.003 |
| 25.700 | M&A Research Institute Holdings Inc | 192.500.241 |
| 134.000 | Skymark Airlines Inc | 186.306.620 |
| 50.000 | Inforich Inc | 181.639.385 |
| 25.000 | Macnica Holdings Inc | 181.086.959 |
| 23.000 | Visional Inc | 175.456.815 |
| 64.000 | USS Co Ltd | 165.835.055 |
| 52.000 | MEC Co Ltd | 164.813.936 |
| 29.800 | Fujimi Inc | 157.687.102 |
| 202.000 | Cover Corp | 154.322.200 |
| 36.000 | Nifco Inc | 149.284.846 |
| 37.000 | Tokyotokeiba Co Ltd | 146.891.922 |
| 52.000 | TKP Corp | 140.782.468 |
| 52.300 | Nareru Group Inc | 138.579.372 |

Japan Equity Engagement – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse JPY |
|-----------|----------------------------------|---------------|
| 1.076.700 | Ricoh Co Ltd | 1.202.481.400 |
| 563.000 | Amada Co Ltd | 801.429.317 |
| 170.200 | FP Partner Inc | 748.138.473 |
| 890.000 | Tokyu Fudosan Holdings Corp | 720.897.312 |
| 136.000 | Zenkoku Hoshu Co Ltd | 674.775.924 |
| 213.000 | Okinawa Cellular Telephone Co | 660.825.824 |
| 280.000 | Shoei Co Ltd | 637.013.553 |
| 126.000 | Yamaha Corp | 559.181.117 |
| 113.400 | Pilot Corp | 534.241.849 |
| 275.000 | Open Up Group Inc | 527.352.009 |
| 303.800 | Musashi Seimitsu Industry Co Ltd | 502.877.189 |
| 198.500 | Cover Corp | 427.851.302 |
| 155.000 | USS Co Ltd | 398.853.253 |
| 96.000 | Nifco Inc | 363.255.699 |
| 270.000 | Daiwa Industries Ltd | 362.821.183 |
| 109.000 | JSB Co Ltd | 346.859.710 |
| 109.000 | Nakanishi Inc | 301.220.905 |
| 101.000 | Niterra Co Ltd | 299.413.023 |
| 142.000 | Kosaido Holdings Co Ltd | 296.464.313 |
| 60.000 | Hokkoku Financial Holdings Inc | 295.018.816 |
| 79.000 | Zuken Inc | 289.566.329 |
| 140.600 | Kansai Paint Co Ltd | 287.487.882 |
| 72.000 | Daiseki Co Ltd | 286.370.456 |
| 244.500 | Direct Marketing MiX Inc | 276.089.386 |
| 106.000 | Yokogawa Electric Corp | 266.311.983 |
| 72.000 | JSR Corp | 265.060.920 |
| 88.000 | BML Inc | 262.116.090 |
| 123.000 | Resorttrust Inc | 260.785.916 |
| 153.000 | Appier Group Inc | 258.463.274 |
| 126.000 | Comture Corp | 257.948.226 |
| 80.000 | St Cousair Co Ltd | 252.126.974 |
| 118.000 | Daiei Kankyo Co Ltd | 240.836.620 |
| 500.000 | Concordia Financial Group Ltd | 240.381.175 |
| 110.700 | Genda Inc | 229.008.372 |
| 41.000 | SHO-BOND Holdings Co Ltd | 221.959.817 |
| 43.900 | As One Corp | 216.117.914 |
| 67.000 | Fujimi Inc | 212.201.390 |
| 115.000 | Yamanashi Chuo Bank Ltd | 211.072.449 |

Macro Opportunities FX – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten EUR |
|-----------|--|------------|
| 3.300.000 | Finland T-Bill, 0.00%, 13/02/2024 | 3.223.736 |
| 2.300.000 | France Treasury Bill BTF, 0.00%, 12/06/2024 | 2.221.796 |
| 1.900.000 | German Treasury Bill, 0.00%, 15/05/2024 | 1.847.393 |
| 1.700.000 | Finland T-Bill, 0.00%, 14/05/2024 | 1.656.763 |
| 1.500.000 | Caisse de Refinancement de l'Habitat SA, 3.60%, 08/03/2024 | 1.498.110 |
| 1.500.000 | Royal Bank of Canada, 0.25%, 29/01/2024 | 1.458.395 |
| 1.500.000 | BNZ International Funding Ltd, 0.50%, 03/07/2024 | 1.454.970 |
| 1.500.000 | Santander UK Plc, 0.10%, 12/05/2024 | 1.451.985 |
| 1.500.000 | German Treasury Bill, 0.00%, 19/06/2024 | 1.448.903 |
| 1.400.000 | BPCE SFH SA, 0.38%, 21/02/2024 | 1.358.560 |
| 1.350.000 | ESM T-Bill, 0.00%, 20/07/2023 | 1.332.511 |
| 1.350.000 | Toronto-Dominion Bank, 0.50%, 03/04/2024 | 1.315.020 |
| 1.300.000 | ESM T-Bill, 0.00%, 23/11/2023 | 1.280.206 |
| 1.300.000 | Credit Agricole Home Loan SFH SA, 0.25%, 23/02/2024 | 1.280.123 |
| 1.000.000 | La Banque Postale Home Loan SFH SA, 2.38%, 15/01/2024 | 991.330 |
| 1.000.000 | Bank of Montreal, 0.25%, 10/01/2024 | 980.880 |
| 1.000.000 | DNB Boligkreditt AS, 0.38%, 14/11/2023 | 980.250 |
| 1.000.000 | Finland T-Bill, 0.00%, 13/11/2023 | 977.405 |
| 1.000.000 | Westpac Securities NZ Ltd, 0.50%, 17/01/2024 | 974.850 |
| 1.000.000 | Dexia Credit Local SA, 0.63%, 03/02/2024 | 974.170 |
| 1.000.000 | Credit Mutuel Home Loan SFH SA, 0.25%, 30/04/2024 | 970.740 |
| 850.000 | Finland T-Bill, 0.00%, 12/04/2023 | 845.714 |
| 800.000 | European Union Bill, 0.00%, 10/11/2023 | 788.112 |
| 600.000 | Societe Generale SFH SA, 2.00%, 29/04/2024 | 591.834 |
| 500.000 | Caisse Centrale du Credit Immobilier de France SA, 0.00%, 17/01/2024 | 484.915 |
| 450.000 | German Treasury Bill, 0.00%, 17/04/2024 | 443.158 |
| 400.000 | Finland T-Bill, 0.00%, 13/03/2024 | 395.239 |

Macro Opportunities FX – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse EUR |
|-----------|---|------------|
| 3.300.000 | Finland T-Bill, 0.00%, 13/02/2024 | 3.246.654 |
| 3.250.000 | Finland T-Bill, 0.00%, 14/08/2023 | 3.231.699 |
| 1.900.000 | German Treasury Bill, 0.00%, 15/05/2024 | 1.855.074 |
| 1.750.000 | France Treasury Bill BTF, 0.00%, 12/06/2024 | 1.710.902 |
| 1.500.000 | Caisse de Refinancement de l'Habitat SA, 3.60%, 08/03/2024 | 1.497.848 |
| 1.500.000 | Cie de Financement Foncier SA, 0.33%, 12/09/2023 | 1.495.035 |
| 1.500.000 | Commerzbank AG, 0.25%, 13/09/2023 | 1.491.870 |
| 1.500.000 | DNB Boligkreditt AS, 0.38%, 14/11/2023 | 1.489.729 |
| 1.500.000 | Bank of Nova Scotia, 0.38%, 23/10/2023 | 1.489.200 |
| 1.500.000 | Santander UK Plc, 0.38%, 20/09/2023 | 1.486.890 |
| 1.500.000 | Royal Bank of Canada, 0.25%, 29/01/2024 | 1.482.549 |
| 1.500.000 | Santander UK Plc, 0.10%, 12/05/2024 | 1.464.960 |
| 1.500.000 | BNZ International Funding Ltd, 0.50%, 03/07/2024 | 1.460.786 |
| 1.400.000 | BPCE SFH SA, 0.38%, 21/02/2024 | 1.381.425 |
| 1.350.000 | ESM T-Bill, 0.00%, 20/07/2023 | 1.344.886 |
| 1.350.000 | Toronto-Dominion Bank, 0.50%, 03/04/2024 | 1.326.728 |
| 1.300.000 | Credit Agricole Home Loan SFH SA, 0.25%, 23/02/2024 | 1.282.242 |
| 1.300.000 | ESM T-Bill, 0.00%, 23/11/2023 | 1.282.028 |
| 1.200.000 | Belfius Bank SA, 0.38%, 24/10/2023 | 1.196.232 |
| 1.200.000 | ESM T-Bill, 0.00%, 20/04/2023 | 1.193.464 |
| 1.050.000 | Finland T-Bill, 0.00%, 14/05/2024 | 1.026.720 |
| 1.000.000 | Caisse de Refinancement de l'Habitat SA, 3.90%, 20/10/2023 | 1.000.690 |
| 1.000.000 | UNEDIC ASSEO, 2.25%, 05/04/2023 | 999.800 |
| 1.000.000 | Arkea Home Loans SFH SA, 2.38%, 11/07/2023 | 999.210 |
| 1.000.000 | National Bank of Canada, 0.00%, 29/09/2023 | 998.840 |
| 1.000.000 | AXA Bank Europe SCF, 0.38%, 23/03/2023 | 998.480 |
| 1.000.000 | BNG Bank NV, 0.05%, 11/07/2023 | 998.372 |
| 1.000.000 | Jyske Realkredit A/S, 0.25%, 01/07/2023 | 998.210 |
| 1.000.000 | DNB Boligkreditt AS, 0.25%, 18/04/2023 | 996.690 |
| 1.000.000 | La Banque Postale Home Loan SFH SA, 2.38%, 15/01/2024 | 995.705 |
| 1.000.000 | OP Mortgage Bank, 0.25%, 11/05/2023 | 995.384 |
| 1.000.000 | Dexia Credit Local SA, 0.25%, 01/06/2023 | 993.920 |
| 1.000.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.13%, 07/06/2023 | 992.540 |
| 1.000.000 | BPCE SFH SA, 2.38%, 29/11/2023 | 992.240 |
| 1.000.000 | Westpac Securities NZ Ltd, 0.50%, 17/01/2024 | 990.983 |
| 1.000.000 | Bank of Montreal, 0.25%, 10/01/2024 | 990.342 |
| 1.000.000 | Dexia Credit Local SA, 0.63%, 03/02/2024 | 989.484 |
| 1.000.000 | Finland T-Bill, 0.00%, 13/11/2023 | 987.896 |
| 1.010.000 | German Treasury Bill, 0.00%, 19/06/2024 | 982.239 |
| 1.000.000 | Credit Mutuel Home Loan SFH SA, 0.25%, 30/04/2024 | 980.199 |
| 900.000 | Societe Generale SFH SA, 0.25%, 11/09/2023 | 898.326 |
| 850.000 | Finland T-Bill, 0.00%, 12/04/2023 | 847.976 |
| 800.000 | Nederlandse Financierings-Maatschappij voor Ontwikkelingslanden NV, 0.13%, 01/06/2023 | 794.664 |
| 800.000 | European Union Bill, 0.00%, 10/11/2023 | 789.972 |
| 600.000 | ANZ New Zealand Int'l Ltd, 0.13%, 22/09/2023 | 599.916 |

Multi-Asset Income – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|---------|--|-------------|
| 2.745 | iShares J.P. Morgan \$ EM Bond UCITS ETF | 237.756 |
| 100.000 | Benteler International Aktiengesellschaft, 9.38%, 15/05/2028 | 109.387 |
| 100.000 | Ford Motor Credit Co LLC, 4.87%, 03/08/2027 | 106.318 |
| 100.000 | Abertis Infraestructuras Finance BV, 3.25%, 29/12/2049 | 98.567 |
| 100.000 | eG Global Finance Plc, 4.38%, 07/02/2025 | 94.857 |
| 80.000 | United States Treasury Note/Bond, 4.00%, 15/11/2052 | 84.149 |
| 80.000 | United States Treasury Note/Bond, 3.00%, 15/11/2044 | 70.118 |
| 65.000 | United States Treasury Note/Bond, 3.13%, 15/05/2048 | 58.028 |
| 65.000 | United States Treasury Note/Bond, 2.38%, 15/05/2051 | 49.686 |
| 65.000 | United States Treasury Note/Bond, 2.00%, 15/11/2041 | 49.249 |
| 62.000 | Capital One Financial Corp, 3.95%, 29/12/2049 | 47.591 |
| 35.000 | Citigroup Inc, 7.38%, 29/12/2049 | 35.000 |
| 35.000 | Truist Financial Corp, 5.10%, 29/12/2049 | 31.161 |
| 30.000 | United States Treasury Note/Bond, 3.50%, 15/02/2033 | 30.245 |
| 30.000 | United States Treasury Note/Bond, 3.88%, 15/02/2043 | 29.594 |
| 35.000 | United States Treasury Note/Bond, 2.50%, 15/02/2045 | 28.341 |
| 900 | New Fortress Energy Inc Class A | 27.223 |
| 3.599 | iShares MSCI India UCITS ETF | 25.879 |
| 246 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR | 21.747 |
| 30.000 | United States Treasury Note/Bond, 2.00%, 15/08/2051 | 21.340 |

20 größte Verkäufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|---------|--|-------------|
| 40.890 | Neuberger Berman China Bond Fund | 407.674 |
| 2.745 | iShares J.P. Morgan \$ EM Bond UCITS ETF | 231.944 |
| 16.300 | Neuberger Berman Commodities Fund | 177.881 |
| 210.000 | NatWest Group Plc, 4.60%, 29/12/2049 | 150.413 |
| 200.000 | ING Groep NV, 3.88%, 29/12/2049 | 142.078 |
| 100.000 | NGG Finance Plc, 5.63%, 18/06/2073 | 120.453 |
| 100.000 | Benteler International Aktiengesellschaft, 9.38%, 15/05/2028 | 111.905 |
| 120.000 | Petroleos Mexicanos, 4.75%, 26/02/2029 | 109.963 |
| 100.000 | Assemblin Financing, 8.53%, 15/05/2025 | 108.861 |
| 100.000 | Ford Motor Credit Co LLC, 4.87%, 03/08/2027 | 107.962 |
| 1.500 | Targa Resources Corp | 105.591 |
| 100.000 | Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH, 2.00%, 15/07/2025 | 104.146 |
| 100.000 | Electricite de France SA, 5.88%, 29/12/2049 | 103.884 |
| 100.000 | Electricite de France SA, 5.00%, 29/12/2049 | 103.689 |
| 100.000 | eG Global Finance Plc, 3.63%, 07/02/2024 | 102.784 |
| 100.000 | eG Global Finance Plc, 4.38%, 07/02/2025 | 102.704 |
| 100.000 | INEOS Finance Plc, 2.88%, 01/05/2026 | 102.396 |
| 100.000 | Gruenthal GmbH, 4.13%, 15/05/2028 | 102.115 |
| 100.000 | Bayer AG, 5.38%, 25/03/2082 | 101.745 |
| 100.000 | Telefonica Europe BV, 3.88%, 29/12/2049 | 101.243 |

Next Generation Mobility – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|---------|------------------------------|-------------|
| 62.393 | MP Materials Corp | 1.254.022 |
| 37.000 | BYD Co Ltd - H Shares | 1.132.744 |
| 2.602 | Deere & Co | 931.852 |
| 4.498 | Autodesk Inc | 880.196 |
| 4.712 | Verisk Analytics Inc Class A | 852.868 |
| 1.839 | LG Chem Ltd | 815.437 |
| 2.068 | LG Energy Solution Ltd | 796.514 |
| 4.135 | Albemarle Corp | 783.349 |
| 3.189 | Caterpillar Inc | 727.813 |
| 4.502 | T-Mobile US Inc | 615.818 |
| 3.624 | Analog Devices Inc | 591.034 |
| 8.839 | Micron Technology Inc | 533.272 |
| 6.509 | Ambarella Inc | 468.631 |
| 2.773 | Schneider Electric SE | 457.745 |
| 1.883 | Cadence Design Systems Inc | 426.540 |
| 3.823 | Amazon.com Inc | 411.451 |
| 5.670 | ON Semiconductor Corp | 410.785 |
| 969 | Monolithic Power Systems Inc | 387.314 |
| 4.205 | Amphenol Corp Class A | 327.371 |
| 2.042 | Keysight Technologies Inc | 326.073 |
| 1.156 | Air Products & Chemicals Inc | 321.286 |
| 2.307 | Tesla Inc | 313.984 |
| 6.264 | Rambus Inc | 303.790 |
| 1.589 | NXP Semiconductors NV | 274.511 |
| 525 | Linde Plc | 171.074 |
| 967 | Texas Instruments Inc | 170.709 |
| 1.456 | Applied Materials Inc | 167.242 |
| 13.999 | ChargePoint Holdings Inc | 167.134 |
| 3.498 | Trimble Inc | 166.992 |
| 267 | ASML Holding NV | 164.680 |

Next Generation Mobility – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|---------|--------------------------------|-------------|
| 11.375 | ANSYS Inc | 3.664.560 |
| 18.069 | Analog Devices Inc | 3.282.116 |
| 55.646 | Rambus Inc | 3.016.657 |
| 7.395 | NVIDIA Corp | 2.785.826 |
| 14.433 | Amazon.com Inc | 1.755.119 |
| 19.543 | Lattice Semiconductor Corp | 1.721.228 |
| 18.480 | Amphenol Corp Class A | 1.582.482 |
| 10.622 | Applied Materials Inc | 1.506.735 |
| 9.385 | Keysight Technologies Inc | 1.469.400 |
| 3.662 | Deere & Co | 1.434.945 |
| 5.975 | Cadence Design Systems Inc | 1.370.991 |
| 6.734 | Autodesk Inc | 1.361.951 |
| 40.768 | Gentex Corp | 1.231.089 |
| 5.026 | Caterpillar Inc | 1.212.095 |
| 2.003 | Monolithic Power Systems Inc | 1.056.973 |
| 18.242 | Magna International Inc | 1.006.410 |
| 34.213 | MP Materials Corp | 968.077 |
| 9.581 | Alphabet Inc Class A | 880.131 |
| 4.236 | Schneider Electric SE | 742.792 |
| 7.054 | BE Semiconductor Industries NV | 742.222 |
| 17.741 | Uber Technologies Inc | 727.549 |
| 4.797 | T-Mobile US Inc | 698.956 |
| 19.404 | General Motors Co | 662.009 |
| 8.349 | Ambarella Inc | 660.894 |
| 2.257 | Air Products & Chemicals Inc | 656.079 |
| 1.695 | Linde Plc | 637.441 |
| 5.029 | Advanced Micro Devices Inc | 612.305 |
| 4.260 | TE Connectivity Ltd | 582.117 |
| 7.349 | ON Semiconductor Corp | 560.228 |
| 1.954 | Tesla Inc | 516.192 |
| 3.557 | Zscaler Inc | 492.822 |
| 7.187 | Altair Engineering Inc Class A | 490.761 |
| 56.386 | NIO Inc ADR | 480.188 |

Next Generation Space Economy – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|---------|--|-------------|
| 3.554 | Boeing Co | 741.238 |
| 116.298 | Rocket Lab USA Inc | 536.326 |
| 10.133 | Iridium Communications Inc | 522.228 |
| 4.816 | NV5 Global Inc | 485.081 |
| 8.226 | Intellian Technologies Inc | 466.409 |
| 204.682 | Spirent Communications Plc | 461.182 |
| 878 | Lockheed Martin Corp | 406.498 |
| 985 | Teledyne Technologies Inc | 394.260 |
| 2.475 | Safran SA | 372.270 |
| 8.800 | Mitsubishi Heavy Industries Ltd | 370.789 |
| 2.434 | Keysight Technologies Inc | 348.507 |
| 10.331 | AXA SA | 313.319 |
| 1.067 | ANSYS Inc | 297.484 |
| 74.037 | Virgin Galactic Holdings Inc | 292.857 |
| 3.800 | Hexcel Corp | 272.210 |
| 2.268 | QUALCOMM Inc | 271.974 |
| 1.971 | Airbus SE | 270.612 |
| 6.300 | NEC Corp | 269.293 |
| 308 | TransDigm Group Inc | 265.274 |
| 2.904 | Hanwha Aerospace Co Ltd | 258.716 |
| 69.846 | Planet Labs PBC | 257.161 |
| 2.672 | Advanced Micro Devices Inc | 255.006 |
| 92.300 | Singapore Technologies Engineering Ltd | 252.553 |
| 5.191 | Trimble Inc | 242.175 |
| 3.350 | Okta Inc Class A | 231.164 |
| 605 | Deere & Co | 229.760 |
| 16.200 | Mitsubishi Electric Corp | 201.371 |
| 36.300 | Toray Industries Inc | 182.409 |
| 41.200 | Shanghai Huace Navigation Technology Ltd Class A | 174.814 |
| 15.950 | Kratos Defense & Security Solutions Inc | 170.723 |
| 36.000 | Universal Microwave Technology Inc | 170.089 |
| 954 | Analog Devices Inc | 169.779 |
| 2.600 | MACOM Technology Solutions Holdings Inc | 164.594 |
| 42.300 | SKY Perfect JSAT Holdings Inc | 159.110 |
| 1.124 | Amazon.com Inc | 133.297 |
| 365 | NVIDIA Corp | 125.138 |

Next Generation Space Economy – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|---------|---|-------------|
| 3.237 | Leidos Holdings Inc | 319.501 |
| 3.241 | RTX Corp | 277.586 |
| 2.563 | Moog Inc Class A | 263.641 |
| 55.400 | SKY Perfect JSAT Holdings Inc | 251.729 |
| 16.545 | Kratos Defense & Security Solutions Inc | 241.186 |
| 40.892 | Rocket Lab USA Inc | 232.823 |
| 2.600 | MACOM Technology Solutions Holdings Inc | 206.134 |
| 1.529 | Airbus SE | 200.916 |
| 1.722 | Advanced Micro Devices Inc | 184.615 |
| 183 | TransDigm Group Inc | 171.360 |
| 30.747 | Universal Microwave Technology Inc | 166.582 |
| 7.662 | Smiths Group Plc | 161.528 |
| 2.984 | Ball Corp | 160.555 |
| 1.152 | Jacobs Solutions Inc | 147.477 |
| 931 | Safran SA | 139.046 |
| 951 | Snowflake Inc Class A | 131.087 |
| 2.358 | Uber Technologies Inc | 118.595 |
| 977 | Arista Networks Inc | 111.517 |
| 1.095 | CrowdStrike Holdings Inc Class A | 106.002 |
| 299 | NVIDIA Corp | 99.162 |
| 1.621 | Intellian Technologies Inc | 98.374 |
| 842 | Zscaler Inc | 92.109 |
| 353 | Motorola Solutions Inc | 91.835 |
| 1.600 | Mitsubishi Heavy Industries Ltd | 90.630 |
| 30.074 | Virgin Galactic Holdings Inc | 89.185 |
| 994 | Okta Inc Class A | 80.669 |
| 500 | Palo Alto Networks Inc | 67.931 |
| 99 | Lockheed Martin Corp | 48.330 |

Resonsible Asian Debt – Hard Currency – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|-----------|--|-------------|
| 2.700.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 14/11/2023 | 2.694.839 |
| 2.500.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 11/01/2024 | 2.483.629 |
| 1.700.000 | Pertamina Persero PT, 6.50%, 27/05/2041 | 1.694.891 |
| 750.000 | Indonesia Government International Bond, 8.50%, 12/10/2035 | 980.550 |
| 1.000.000 | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara, 6.15%, 21/05/2048 | 975.000 |
| 950.000 | Mongolia Government International Bond, 8.65%, 19/01/2028 | 961.604 |
| 1.000.000 | Mongolia Government International Bond, 5.13%, 07/04/2026 | 897.500 |
| 784.000 | Standard Chartered Plc, 6.30%, 06/07/2034 | 784.000 |
| 780.000 | State Bank of India, 4.88%, 05/05/2028 | 777.644 |
| 750.000 | Indonesia Government International Bond, 4.85%, 11/01/2033 | 739.860 |
| 900.000 | Indonesia Government International Bond, 1.10%, 12/03/2033 | 730.909 |
| 700.000 | Adani Green Energy UP Ltd/Prayatna Developers Pvt Ltd/Parampujya Solar Energy, 6.25%, 10/12/2024 | 666.660 |
| 600.000 | Export-Import Bank of Korea, 5.00%, 11/01/2028 | 620.406 |
| 600.000 | Standard Chartered Plc, 6.30%, 09/01/2029 | 619.840 |
| 600.000 | AIA Group Ltd, 4.95%, 04/04/2033 | 602.066 |
| 600.000 | Industrial & Commercial Bank of China Ltd, 4.88%, 21/09/2025 | 597.598 |
| 600.000 | Bank of China Ltd, 5.00%, 13/11/2024 | 593.249 |
| 500.000 | Philippine Government International Bond, 6.38%, 23/10/2034 | 566.875 |
| 600.000 | Medco Bell Pte Ltd, 6.38%, 30/01/2027 | 561.470 |
| 600.000 | United Overseas Bank Ltd, 3.86%, 07/10/2032 | 560.691 |

Responsible Asian Debt – Hard Currency – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|-----------|--|-------------|
| 1.000.000 | Mongolia Government International Bond, 5.13%, 07/04/2026 | 953.800 |
| 1.000.000 | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara, 6.15%, 21/05/2048 | 902.550 |
| 700.000 | Indonesia Government International Bond, 5.25%, 17/01/2042 | 694.112 |
| 1.100.000 | Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd, 3.10%, 08/01/2051 | 661.903 |
| 600.000 | GENM Capital Labuan Ltd, 3.88%, 19/04/2031 | 471.300 |
| 500.000 | Chinalco Capital Holdings Ltd, 2.13%, 03/06/2026 | 455.773 |
| 444.000 | Philippine Government International Bond, 5.50%, 17/01/2048 | 447.645 |
| 454.000 | China Life Insurance Overseas Co Ltd, 5.35%, 15/08/2033 | 440.888 |
| 400.000 | ABJA Investment Co Pte Ltd, 5.45%, 24/01/2028 | 400.480 |
| 400.000 | CLP Power HK Finance Ltd, 3.55%, 29/12/2049 | 381.500 |
| 380.000 | State Bank of India, 4.88%, 05/05/2028 | 377.940 |
| 375.000 | ROP Sukuk Trust, 5.05%, 06/06/2029 | 374.681 |
| 400.000 | Sands China Ltd, 5.65%, 08/08/2028 | 368.800 |
| 600.000 | Longfor Group Holdings Ltd, 3.95%, 16/09/2029 | 361.500 |
| 400.000 | Melco Resorts Finance Ltd, 5.75%, 21/07/2028 | 339.200 |
| 400.000 | Wynn Macau Ltd, 5.63%, 26/08/2028 | 335.000 |
| 400.000 | Studio City Finance Ltd, 6.50%, 15/01/2028 | 328.080 |
| 400.000 | Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd, 2.30%, 08/01/2031 | 327.768 |
| 325.000 | Shinhan Bank Co Ltd, 4.50%, 12/04/2028 | 319.953 |
| 300.000 | Mongolia Government International Bond, 8.65%, 19/01/2028 | 316.743 |
| 300.000 | Hongkong Land Finance Cayman Islands Co Ltd, 5.25%, 14/07/2033 | 300.900 |
| 300.000 | Mongolia Government International Bond, 7.88%, 05/06/2029 | 300.030 |
| 300.000 | Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd, 3.38%, 29/12/2049 | 292.550 |
| 284.000 | Standard Chartered Plc, 6.30%, 06/07/2034 | 288.544 |
| 222.000 | Philippine Government International Bond, 5.00%, 17/07/2033 | 222.555 |
| 400.000 | Sri Lanka Government International Bond, 6.85%, 14/03/2024 | 208.080 |
| 200.000 | Export-Import Bank of Korea, 5.13%, 11/01/2033 | 207.106 |
| 400.000 | Sri Lanka Government International Bond, 6.20%, 11/05/2027 | 204.000 |
| 200.000 | Airport Authority, 4.88%, 12/01/2030 | 202.350 |
| 200.000 | China Resources Land Ltd, 6.00%, 27/02/2024 | 201.680 |
| 200.000 | Airport Authority, 4.88%, 12/01/2033 | 201.510 |
| 200.000 | Kasikornbank PCL, 5.46%, 07/03/2028 | 201.508 |
| 200.000 | POSCO, 5.75%, 17/01/2028 | 200.896 |
| 200.000 | AIA Group Ltd, 4.95%, 04/04/2033 | 200.654 |
| 200.000 | Airport Authority, 4.75%, 12/01/2028 | 200.076 |
| 200.000 | Indonesia Government International Bond, 5.65%, 11/01/2053 | 199.800 |
| 200.000 | SK Telecom Co Ltd, 3.75%, 16/04/2023 | 199.348 |
| 200.000 | China Construction Bank Corp, 4.25%, 27/02/2029 | 198.700 |
| 200.000 | TNB Global Ventures Capital Bhd, 4.85%, 01/11/2028 | 198.340 |
| 200.000 | Adani Green Energy UP Ltd/Prayatna Developers Pvt Ltd/Parampujya Solar Energy, 6.25%, 10/12/2024 | 197.100 |
| 200.000 | Cathay Pacific MTN Financing HK Ltd, 4.88%, 17/08/2026 | 195.260 |
| 200.000 | Vedanta Resources Finance II Plc, 13.88%, 21/01/2024 | 192.000 |

Short Duration Emerging Market Debt – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|------------|--|-------------|
| 87.100.000 | Colombia Government International Bond, 4.50%, 15/03/2029 | 77.586.963 |
| 74.906.000 | Serbia International Bond, 3.13%, 15/05/2027 | 73.744.570 |
| 55.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 23/05/2024 | 53.574.195 |
| 50.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 24/11/2023 | 48.800.083 |
| 44.000.000 | United States Treasury Note/Bond, 4.88%, 31/10/2028 | 44.905.781 |
| 43.930.000 | Comision Federal de Electricidad, 4.69%, 15/05/2029 | 39.957.420 |
| 37.754.000 | Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp, 5.38%, 11/05/2028 | 37.463.294 |
| 42.400.000 | Serbia International Bond, 1.00%, 23/09/2028 | 35.941.992 |
| 28.500.000 | Romanian Government International Bond, 5.50%, 18/09/2028 | 30.484.235 |
| 24.300.000 | Romanian Government International Bond, 6.63%, 27/09/2029 | 26.898.127 |
| 26.610.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 27/07/2023 | 25.988.349 |
| 27.280.000 | Dominican Republic International Bond, 5.50%, 22/02/2029 | 25.674.440 |
| 25.371.000 | Korea Housing Finance Corp, 4.63%, 24/02/2028 | 25.232.474 |
| 25.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 04/04/2023 | 24.931.594 |
| 25.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00% 02/05/2023 | 24.916.469 |
| 25.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 11/07/2023 | 24.597.631 |
| 25.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 05/09/2023 | 24.586.806 |
| 25.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 26/09/2023 | 24.565.733 |
| 24.831.000 | MFB Magyar Fejlesztési Bank Zrt, 6.50%, 29/06/2028 | 24.556.866 |
| 25.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 11/01/2024 | 24.334.626 |
| 24.100.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 24/10/2023 | 24.004.654 |
| 20.000.000 | Ecopetrol SA, 8.63%, 19/01/2029 | 20.495.000 |
| 20.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 25/04/2024 | 19.461.937 |
| 20.305.000 | Ivory Coast Government International Bond, 5.25%, 22/03/2030 | 18.300.577 |
| 17.799.000 | Serbia International Bond, 6.25%, 26/05/2028 | 17.732.610 |
| 16.930.000 | Romanian Government International Bond, 2.88%, 26/05/2028 | 16.492.300 |
| 16.000.000 | First Abu Dhabi Bank PJSC, 4.38%, 24/04/2028 | 15.894.240 |
| 16.157.000 | Adani Green Energy UP Ltd/Prayatna Developers Pvt Ltd/Parampujya Solar Energy, 6.25%, 10/12/2024 | 15.591.373 |
| 15.367.000 | Corp Andina de Fomento, 6.00%, 26/04/2027 | 15.350.711 |
| 14.467.000 | Commercial Bank of Dubai PSC, 5.32%, 14/06/2028 | 14.467.000 |

Short Duration Emerging Market Debt – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|------------|---|-------------|
| 52.245.000 | QatarEnergy Trading LLC, 1.38%, 12/09/2026 | 46.876.331 |
| 35.500.000 | Egypt Government International Bond, 4.75%, 11/04/2025 | 33.772.405 |
| 31.971.000 | Republic of Poland Government International Bond, 5.50%, 16/11/2027 | 32.951.872 |
| 29.710.000 | Qatar Government International Bond, 3.38%, 14/03/2024 | 29.156.851 |
| 28.660.000 | QIB Sukuk Ltd, 3.98%, 26/03/2024 | 28.395.812 |
| 29.461.000 | Egypt Government International Bond, 5.75%, 29/05/2024 | 26.748.498 |
| 230.000 | Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund | 25.766.900 |
| 25.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 02/05/2023 | 24.944.517 |
| 25.648.000 | Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd, 3.38%, 29/12/2049 | 24.842.605 |
| 25.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 11/01/2024 | 24.817.813 |
| 25.000.000 | Rongshi International Finance Ltd, 3.25%, 21/05/2024 | 24.520.250 |
| 24.500.000 | Colombia Government International Bond, 4.50%, 28/01/2026 | 23.703.750 |
| 22.000.000 | QNB Finance Ltd, 3.50%, 28/03/2024 | 21.701.240 |
| 21.950.000 | Ecopetrol SA, 4.13%, 16/01/2025 | 21.196.475 |
| 21.000.000 | Dominican Republic International Bond, 6.88%, 29/01/2026 | 21.014.500 |
| 21.000.000 | Dominican Republic International Bond, 5.50%, 27/01/2025 | 20.758.500 |
| 18.700.000 | Ivory Coast Government International Bond, 5.13%, 15/06/2025 | 20.518.272 |
| 20.000.000 | Republic of South Africa Government International Bond, 5.88%, 16/09/2025 | 19.911.200 |
| 20.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 25/04/2024 | 19.551.361 |
| 18.800.000 | China Huadian Overseas Development Management Co Ltd, 4.00%, 29/12/2049 | 18.611.640 |
| 17.799.000 | Serbia International Bond, 6.25%, 26/05/2028 | 18.217.892 |
| 18.000.000 | CCBL Cayman 1 Corp Ltd, 3.50%, 16/05/2024 | 17.705.480 |
| 17.240.000 | Indonesia Government International Bond, 1.75%, 24/04/2025 | 17.511.401 |
| 18.174.000 | Chinalco Capital Holdings Ltd, 2.13%, 03/06/2026 | 16.738.498 |
| 17.791.000 | Chile Government International Bond, 2.75%, 31/01/2027 | 16.561.415 |
| 17.000.000 | Ivory Coast Government International Bond, 6.38%, 03/03/2028 | 16.560.000 |
| 16.262.000 | Mashreqbank PSC, 4.25%, 26/02/2024 | 16.127.283 |

Short Duration High Yield SDG Engagement – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|-----------|--|-------------|
| 9.270.000 | Gen Digital Inc, 6.75%, 30/09/2027 | 9.309.279 |
| 9.045.000 | Ally Financial Inc, 5.75%, 20/11/2025 | 8.850.494 |
| 8.505.000 | American Airlines Inc, 7.25%, 15/02/2028 | 8.332.100 |
| 8.060.000 | TransDigm Inc, 7.50%, 15/03/2027 | 8.067.694 |
| 8.665.000 | Air Canada, 3.88%, 15/08/2026 | 7.958.854 |
| 7.700.000 | Avient Corp, 5.75%, 15/05/2025 | 7.643.765 |
| 7.000.000 | Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC, 10.50%, 15/02/2028 | 7.001.737 |
| 6.920.000 | Mauser Packaging Solutions Holding Co, 7.88%, 15/08/2026 | 6.934.400 |
| 7.370.000 | EnerSys, 4.38%, 15/12/2027 | 6.899.014 |
| 7.150.000 | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp, 5.13%, 01/05/2027 | 6.751.854 |
| 6.580.000 | Civitas Resources Inc, 8.38%, 01/07/2028 | 6.632.342 |
| 6.800.000 | Camelot Return Merger Sub Inc, 8.75%, 01/08/2028 | 6.519.850 |
| 6.455.000 | Energizer Holdings Inc, 6.50%, 31/12/2027 | 6.310.174 |
| 6.710.000 | Hudbay Minerals Inc, 4.50%, 01/04/2026 | 6.275.840 |
| 6.385.000 | William Carter Co, 5.63%, 15/03/2027 | 6.169.770 |
| 6.840.000 | Sirius XM Radio Inc, 4.00%, 15/07/2028 | 5.999.226 |
| 5.955.000 | Regal Rexnord Corp, 6.05%, 15/02/2026 | 5.937.956 |
| 6.300.000 | VOC Escrow Ltd, 5.00%, 15/02/2028 | 5.885.513 |
| 5.685.000 | KB Home, 6.88%, 15/06/2027 | 5.794.588 |
| 5.875.000 | Tenet Healthcare Corp, 6.25%, 01/02/2027 | 5.754.556 |

Short Duration High Yield SDG Engagement – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|-----------|---|-------------|
| 9.384.167 | American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd, 5.50%, 20/04/2026 | 9.215.174 |
| 8.670.000 | Hudbay Minerals Inc, 4.50%, 01/04/2026 | 8.194.438 |
| 8.510.000 | Air Canada, 3.88%, 15/08/2026 | 7.901.351 |
| 7.926.000 | EPR Properties, 4.50%, 01/04/2025 | 7.657.149 |
| 7.855.000 | APX Group Inc, 6.75%, 15/02/2027 | 7.644.344 |
| 7.795.000 | LPL Holdings Inc, 4.63%, 15/11/2027 | 7.323.761 |
| 7.150.000 | US Foods Inc, 6.25%, 15/04/2025 | 7.155.972 |
| 7.795.000 | Garda World Security Corp, 4.63%, 15/02/2027 | 6.859.600 |
| 6.460.000 | Ally Financial Inc, 5.75%, 20/11/2025 | 6.062.836 |
| 6.055.000 | Avient Corp, 5.75%, 15/05/2025 | 6.004.844 |
| 6.330.000 | Sirius XM Radio Inc, 5.00%, 01/08/2027 | 5.899.630 |
| 6.335.000 | WR Grace Holdings LLC, 4.88%, 15/06/2027 | 5.789.858 |
| 6.605.000 | Sunnova Energy Corp, 5.88%, 01/09/2026 | 5.587.166 |
| 5.525.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 22/06/2023 | 5.445.027 |
| 5.635.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 30/11/2023 | 5.432.745 |
| 5.620.000 | Legends Hospitality Holding Co LLC/Legends Hospitality Co-Issuer Inc, 5.00%, 01/02/2026 | 5.391.721 |
| 5.285.000 | KB Home, 6.88%, 15/06/2027 | 5.307.568 |
| 6.205.000 | Blackstone Mortgage Trust Inc, 3.75%, 15/01/2027 | 5.282.006 |
| 5.195.000 | CSC Holdings LLC, 5.25%, 01/06/2024 | 5.113.474 |
| 5.115.000 | Avolon Holdings Funding Ltd, 5.25%, 15/05/2024 | 5.053.889 |

Strategic Income – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|-------------|---|-------------|
| 121.655.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 11/01/2024 | 120.013.014 |
| 104.355.000 | Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/05/2046 | 100.850.543 |
| 100.715.000 | Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/06/2049 | 96.805.117 |
| 95.955.000 | Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/02/2043 | 94.319.676 |
| 92.790.000 | Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/05/2043 | 91.714.039 |
| 87.140.000 | Fannie Mae Pool, 4.50%, 25/03/2044 | 86.072.887 |
| 86.120.000 | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/08/2053 | 85.439.618 |
| 84.800.000 | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/01/2054 | 84.250.155 |
| 89.340.000 | Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/07/2053 | 84.182.823 |
| 87.425.000 | Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/04/2046 | 84.071.679 |
| 85.080.000 | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/09/2054 | 83.839.496 |
| 85.405.000 | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/12/2052 | 82.930.719 |
| 82.805.000 | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/10/2054 | 81.058.044 |
| 86.485.000 | Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/06/2043 | 79.813.359 |
| 81.905.000 | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/11/2043 | 78.396.076 |
| 79.205.000 | Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/04/2043 | 74.857.567 |
| 75.640.000 | Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/06/2049 | 74.263.671 |
| 69.930.000 | Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/07/2053 | 67.601.463 |
| 70.585.000 | Fannie Mae Pool, 4.00%, 14/09/2042 | 65.489.749 |
| 64.458.795 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1.63%, 15/10/2027 | 65.017.774 |
| 65.710.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 13/04/2023 | 65.012.607 |
| 68.135.000 | Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/08/2042 | 64.635.863 |
| 63.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 05/12/2023 | 62.733.334 |
| 60.170.000 | Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/05/2053 | 60.353.658 |
| 60.695.000 | Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/04/2054 | 59.532.784 |
| 60.020.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 12/10/2023 | 59.235.239 |
| 58.190.000 | Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/02/2043 | 58.222.438 |

Strategic Income – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|-------------|---|-------------|
| 104.355.000 | Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/05/2046 | 100.188.986 |
| 100.715.000 | Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/06/2049 | 94.896.648 |
| 95.955.000 | Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/02/2043 | 94.815.429 |
| 92.790.000 | Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/05/2043 | 91.096.586 |
| 87.425.000 | Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/04/2046 | 86.437.923 |
| 86.120.000 | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/08/2053 | 84.895.079 |
| 85.405.000 | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/12/2052 | 84.803.962 |
| 87.140.000 | Fannie Mae Pool, 4.50%, 25/03/2044 | 83.740.348 |
| 85.080.000 | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/09/2054 | 83.313.757 |
| 89.340.000 | Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/07/2053 | 82.479.774 |
| 86.485.000 | Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/06/2043 | 80.301.915 |
| 81.905.000 | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/11/2043 | 79.415.437 |
| 82.805.000 | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/10/2054 | 79.267.725 |
| 79.205.000 | Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/04/2043 | 76.670.548 |
| 75.640.000 | Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/06/2049 | 73.071.869 |
| 69.930.000 | Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/07/2053 | 66.379.805 |
| 68.135.000 | Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/08/2042 | 64.482.404 |
| 70.585.000 | Fannie Mae Pool, 4.00%, 14/09/2042 | 64.388.461 |
| 65.573.123 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1.63%, 15/10/2027 | 64.307.766 |
| 60.695.000 | Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/04/2054 | 60.873.904 |
| 60.170.000 | Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/05/2053 | 60.044.145 |
| 58.190.000 | Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/02/2043 | 58.001.891 |
| 58.115.000 | Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/02/2043 | 56.101.403 |
| 57.500.000 | Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/09/2043 | 53.955.371 |
| 55.055.000 | Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/03/2043 | 53.926.472 |
| 59.810.000 | Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/10/2043 | 52.482.690 |
| 55.750.000 | Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/03/2043 | 52.064.280 |
| 54.380.000 | Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/10/2042 | 49.238.719 |
| 50.625.000 | Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/01/2054 | 46.378.717 |

Sustainable Asia High Yield – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|-----------|--|-------------|
| 1.150.000 | Standard Chartered Plc, 4.30%, 29/12/2049 | 882.535 |
| 750.000 | Standard Chartered Plc, 7.75%, 29/12/2049 | 758.600 |
| 667.000 | Philippine Government International Bond, 5.50%, 17/01/2048 | 667.000 |
| 700.000 | Huarong Finance 2019 Co Ltd, 4.50%, 29/05/2029 | 544.750 |
| 510.000 | State Bank of India, 4.88%, 05/05/2028 | 508.460 |
| 390.000 | CK Hutchison International 2 Ltd, 4.88%, 21/04/2033 | 388.171 |
| 400.000 | Huarong Finance II Co Ltd, 4.63%, 03/06/2026 | 352.750 |
| 400.000 | Axis Bank Ltd, 4.10%, 29/12/2049 | 351.000 |
| 400.000 | Studio City Finance Ltd, 6.50%, 15/01/2028 | 349.800 |
| 350.000 | Shinhan Bank Co Ltd, 4.50%, 12/04/2028 | 348.499 |
| 400.000 | Huarong Finance 2017 Co Ltd, 4.75%, 27/04/2027 | 348.250 |
| 400.000 | HDFC Bank Ltd, 3.70%, 29/12/2049 | 347.700 |
| 400.000 | Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT, 4.30%, 29/12/2049 | 333.300 |
| 333.000 | Philippine Government International Bond, 5.00%, 17/07/2033 | 332.973 |
| 400.000 | Melco Resorts Finance Ltd, 5.38%, 04/12/2029 | 331.400 |
| 400.000 | Vedanta Resources Finance II Plc, 8.95%, 11/03/2025 | 307.000 |
| 500.000 | Sino-Ocean Land Treasure III Ltd, 4.90%, 31/12/2049 | 300.000 |
| 300.000 | Hongkong Land Finance Cayman Islands Co Ltd, 5.25%, 14/07/2033 | 299.307 |
| 300.000 | Korea Land and Housing, 5.75%, 06/10/2025 | 299.292 |
| 300.000 | China CITIC Bank International, 6.00%, 05/12/2033 | 298.890 |
| 300.000 | POSCO, 5.75%, 17/01/2028 | 298.524 |
| 400.000 | Huarong Finance 2019 Co Ltd, 3.38%, 24/02/2030 | 288.000 |
| 300.000 | Bangkok Bank PCL, 5.00%, 29/12/2049 | 275.625 |
| 273.000 | China Life Insurance Overseas Co Ltd, 5.35%, 15/08/2033 | 273.000 |
| 300.000 | Krung Thai Bank PCL, 4.40%, 29/12/2049 | 271.500 |
| 262.000 | Standard Chartered Plc, 6.30%, 06/07/2034 | 262.000 |
| 250.000 | ROP Sukuk Trust, 5.05%, 06/06/2029 | 250.000 |
| 250.000 | Woori Bank, 4.88%, 26/01/2028 | 249.125 |
| 250.000 | BOC Aviation USA Corp, 4.88%, 03/05/2033 | 247.275 |
| 229.000 | Industrial Bank of Korea, 5.38%, 04/10/2028 | 228.187 |
| 550.000 | Sri Lanka Government International Bond, 6.85%, 03/11/2025 | 204.600 |
| 200.000 | Khazanah Capital Ltd, 4.88%, 01/06/2033 | 200.000 |
| 200.000 | LG Energy Solution Ltd, 5.75%, 25/09/2028 | 199.828 |
| 200.000 | REC Ltd, 5.63%, 11/04/2028 | 199.708 |
| 200.000 | CK Hutchison International 23 Ltd, 4.75%, 21/04/2028 | 199.596 |
| 200.000 | Hyundai Capital America, 5.68%, 26/06/2028 | 199.484 |
| 200.000 | Airport Authority, 4.75%, 12/01/2028 | 199.410 |
| 200.000 | Export-Import Bank of Korea, 5.13%, 11/01/2033 | 199.180 |
| 200.000 | Airport Authority, 4.88%, 12/01/2030 | 198.760 |
| 200.000 | Airport Authority, 4.88%, 12/01/2033 | 198.516 |
| 200.000 | SK Hynix Inc, 6.50%, 17/01/2033 | 196.820 |
| 200.000 | Standard Chartered Plc, 6.00%, 29/12/2049 | 194.500 |
| 200.000 | Sands China Ltd, 5.65%, 08/08/2028 | 193.000 |
| 250.000 | Bank of East Asia Ltd, 5.83%, 29/12/2049 | 191.875 |

Sustainable Asia High Yield – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen: (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|---------|--|-------------|
| 200.000 | Adani Green Energy UP Ltd/Prayatna Developers Pvt Ltd/Parampujya Solar Energy, 6.25%, 10/12/2024 | 191.000 |
| 200.000 | Kasikornbank PCL, 5.28%, 29/12/2049 | 189.300 |
| 200.000 | ReNew Power Pvt Ltd, 5.88%, 05/03/2027 | 187.750 |
| 200.000 | ENN Clean Energy International Investment Ltd, 3.38%, 12/05/2026 | 187.100 |
| 200.000 | Huarong Finance II Co Ltd, 5.00%, 19/11/2025 | 183.900 |

Sustainable Asia High Yield – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|-----------|--|-------------|
| 900.000 | Sands China Ltd, 5.65%, 08/08/2028 | 857.840 |
| 667.000 | Philippine Government International Bond, 5.50%, 17/01/2048 | 670.335 |
| 550.000 | Standard Chartered Plc, 7.75%, 29/12/2049 | 532.125 |
| 510.000 | State Bank of India, 4.88%, 05/05/2028 | 507.236 |
| 510.000 | Cathay Pacific MTN Financing HK Ltd, 4.88%, 17/08/2026 | 497.641 |
| 1.350.000 | Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd, 2.70%, 13/01/2025 | 453.475 |
| 390.000 | CK Hutchison International 2 Ltd, 4.88%, 21/04/2033 | 390.027 |
| 400.000 | Medco Bell Pte Ltd, 6.38%, 30/01/2027 | 379.200 |
| 400.000 | Vedanta Resources Finance II Plc, 13.88%, 21/01/2024 | 376.500 |
| 400.000 | Singapore Airlines Ltd, 3.38%, 19/01/2029 | 365.204 |
| 400.000 | Melco Resorts Finance Ltd, 5.63%, 17/07/2027 | 359.000 |
| 350.000 | Shinhan Bank Co Ltd, 4.50%, 12/04/2028 | 349.461 |
| 400.000 | Bangkok Bank PCL, 3.73%, 25/09/2034 | 343.988 |
| 400.000 | CAS Capital No 1 Ltd, 4.00%, 29/12/2049 | 329.200 |
| 350.000 | Ca Magnum Holdings, 5.38%, 31/10/2026 | 326.375 |
| 330.000 | FWD Group Holdings Ltd, 8.05%, 29/12/2049 | 320.925 |
| 450.000 | Shui On Development Holding Ltd, 6.15%, 24/08/2024 | 309.800 |
| 310.000 | FWD Group Holdings Ltd, 5.75%, 09/07/2024 | 306.125 |
| 300.000 | China CITIC Bank International, 6.00%, 05/12/2033 | 302.580 |
| 400.000 | Huarong Finance 2019 Co Ltd, 3.38%, 24/02/2030 | 302.000 |
| 300.000 | POSCO, 5.75%, 17/01/2028 | 301.344 |
| 300.000 | Hongkong Land Finance Cayman Islands Co Ltd, 5.25%, 14/07/2033 | 300.900 |
| 300.000 | Wynn Macau Ltd, 4.88%, 01/10/2024 | 292.500 |
| 305.000 | ReNew Power Pvt Ltd, 5.88%, 05/03/2027 | 286.319 |
| 273.000 | China Life Insurance Overseas Co Ltd, 5.35%, 15/08/2033 | 268.059 |
| 300.000 | Kasikornbank PCL, 3.34%, 02/10/2031 | 266.481 |
| 262.000 | Standard Chartered Plc, 6.30%, 06/07/2034 | 266.192 |
| 300.000 | Central Plaza Development Ltd, 5.75%, 29/12/2049 | 265.800 |
| 300.000 | Krung Thai Bank PCL, 4.40%, 29/12/2049 | 265.125 |
| 300.000 | Melco Resorts Finance Ltd, 5.75%, 21/07/2028 | 259.500 |
| 250.000 | Woori Bank, 4.88%, 26/01/2028 | 255.375 |
| 350.000 | PCPD Capital Ltd, 5.13%, 18/06/2026 | 253.750 |
| 250.000 | ROP Sukuk Trust, 5.05%, 06/06/2029 | 249.788 |
| 250.000 | BOC Aviation USA Corp, 4.88%, 03/05/2033 | 248.435 |
| 300.000 | GENM Capital Labuan Ltd, 3.88%, 19/04/2031 | 243.000 |
| 300.000 | Elect Global Investments Ltd, 4.10%, 29/12/2049 | 238.350 |
| 200.000 | Export-Import Bank of Korea, 5.13%, 11/01/2033 | 208.362 |
| 200.000 | Airport Authority, 4.88%, 12/01/2030 | 202.350 |
| 200.000 | Airport Authority, 4.88%, 12/01/2033 | 201.510 |
| 200.000 | CK Hutchison International 23 Ltd, 4.75%, 21/04/2028 | 200.586 |
| 200.000 | Khazanah Capital Ltd, 4.88%, 01/06/2033 | 200.538 |
| 200.000 | Airport Authority, 4.75%, 12/01/2028 | 200.398 |
| 200.000 | REC Ltd, 5.63%, 11/04/2028 | 199.782 |
| 200.000 | Medco Oak Tree Pte Ltd, 7.38%, 14/05/2026 | 199.500 |

Sustainable Asia High Yield – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen (Fortsetzung):

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|---------|--|-------------|
| 200.000 | Celestial Miles Ltd, 5.75%, 29/12/2049 | 198.000 |
| 200.000 | Adani Green Energy UP Ltd/Prayatna Developers Pvt Ltd/Parampujya Solar Energy, 6.25%, 10/12/2024 | 197.100 |
| 200.000 | Periama Holdings LLC, 5.95%, 19/04/2026 | 195.300 |
| 200.000 | MGM China Holdings Ltd, 5.88%, 15/05/2026 | 192.500 |
| 260.000 | NWD MTN Ltd, 4.13%, 18/07/2029 | 191.152 |
| 350.000 | Sino-Ocean Land Treasure Finance I Ltd, 6.00%, 30/07/2024 | 185.500 |
| 200.000 | Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT, 3.75%, 30/03/2026 | 185.440 |

Sustainable Emerging Market Corporate Debt – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|---------|--|-------------|
| 887.000 | Ecopetrol SA, 8.88%, 13/01/2033 | 879.875 |
| 851.000 | Banco do Brasil SA, 6.25%, 18/04/2030 | 839.188 |
| 800.000 | Kosmos Energy Ltd, 7.13%, 04/04/2026 | 722.050 |
| 726.000 | Romanian Government International Bond, 7.13%, 17/01/2033 | 721.150 |
| 640.000 | Adib Sukuk Co II Ltd, 5.70%, 15/11/2028 | 640.000 |
| 643.000 | Brazilian Government International Bond, 6.00%, 20/10/2033 | 635.599 |
| 559.000 | Israel Discount Bank Ltd, 5.38%, 26/01/2028 | 559.767 |
| 600.000 | KazMunayGas National Co JSC, 4.75%, 19/04/2027 | 556.245 |
| 600.000 | Medco Bell Pte Ltd, 6.38%, 30/01/2027 | 549.800 |
| 546.000 | Colombia Government International Bond, 7.50%, 02/02/2034 | 537.170 |
| 534.000 | Cemex SAB de CV, 9.13%, 29/12/2049 | 534.000 |
| 485.000 | Bank Gospodarstwa Krajowego, 5.13%, 22/02/2033 | 516.994 |
| 509.000 | Azul Secured Finance LLP, 11.93%, 28/08/2028 | 502.749 |
| 495.000 | Yapi ve Kredi Bankasi AS, 9.25%, 16/10/2028 | 492.431 |
| 500.000 | Cencosud SA, 4.38%, 17/07/2027 | 485.000 |
| 483.000 | Standard Chartered Plc, 6.30%, 06/07/2034 | 483.000 |
| 540.000 | Millicom International Cellular SA, 6.25%, 25/03/2029 | 480.330 |
| 600.000 | Vedanta Resources Finance II Plc, 8.95%, 11/03/2025 | 457.900 |
| 500.000 | Cia de Minas Buenaventura SAA, 5.50%, 23/07/2026 | 455.150 |
| 550.000 | KazMunayGas National Co JSC, 5.75%, 19/04/2047 | 453.400 |

Sustainable Emerging Market Corporate Debt – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|---------|---|-------------|
| 726.000 | Romanian Government International Bond, 7.13%, 17/01/2033 | 720.555 |
| 656.000 | Colombia Government International Bond, 8.00%, 20/04/2033 | 686.242 |
| 688.000 | First Quantum Minerals Ltd, 6.88%, 15/10/2027 | 644.600 |
| 643.000 | Brazilian Government International Bond, 6.00%, 20/10/2033 | 634.523 |
| 700.000 | Trust Fibra Uno, 4.87%, 15/01/2030 | 609.000 |
| 574.000 | Celestial Miles Ltd, 5.75%, 29/12/2049 | 567.360 |
| 559.000 | Israel Discount Bank Ltd, 5.38%, 26/01/2028 | 559.154 |
| 600.000 | Cencosud SA, 4.38%, 17/07/2027 | 556.620 |
| 600.000 | Vedanta Resources Finance II Plc, 13.88%, 21/01/2024 | 548.960 |
| 546.000 | Colombia Government International Bond, 7.50%, 02/02/2034 | 532.721 |
| 509.000 | Azul Secured Finance LLP, 11.93%, 28/08/2028 | 504.212 |
| 500.000 | Banco do Brasil SA, 6.25%, 18/04/2030 | 493.000 |
| 557.000 | Alpek SAB de CV, 4.25%, 18/09/2029 | 491.725 |
| 479.000 | Medco Oak Tree Pte Ltd, 7.38%, 14/05/2026 | 475.013 |
| 531.000 | Endeavour Mining Plc, 5.00%, 14/10/2026 | 474.963 |
| 500.000 | China Construction Bank Corp, 2.45%, 24/06/2030 | 470.194 |
| 536.000 | Stillwater Mining Co, 4.00%, 16/11/2026 | 466.538 |
| 446.000 | Shinhan Financial Group Co Ltd, 5.88%, 29/12/2049 | 440.209 |
| 500.000 | Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd, 2.30%, 08/01/2031 | 439.560 |
| 407.000 | Republic of Poland Government International Bond, 4.25%, 14/02/2043 | 428.313 |

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|------------|---|-------------|
| 14.534.000 | Colombia Government International Bond, 7.50%, 02/02/2034 | 13.968.140 |
| 12.599.000 | Morocco Government International Bond, 6.50%, 08/09/2033 | 12.470.210 |
| 13.320.000 | Romanian Government International Bond, 3.75%, 07/02/2034 | 11.742.561 |
| 37.038.444 | Argentine Republic Government International Bond, 3.63%, 09/07/2035 | 10.249.274 |
| 10.523.000 | Oman Government International Bond, 6.75%, 17/01/2048 | 10.147.861 |
| 11.448.000 | Peruvian Government International Bond, 1.25%, 11/03/2033 | 9.394.305 |
| 9.446.000 | Brazilian Government International Bond, 6.00%, 20/10/2033 | 9.284.352 |
| 11.079.000 | Morocco Government International Bond, 3.00%, 15/12/2032 | 8.781.731 |
| 9.060.000 | Chile Government International Bond, 1.88%, 27/05/2030 | 8.726.997 |
| 10.140.000 | Serbia International Bond, 1.50%, 26/06/2029 | 8.659.958 |
| 9.283.000 | Dominican Republic International Bond, 6.00%, 22/02/2033 | 8.640.375 |
| 8.888.000 | Mexico Government International Bond, 5.75%, 12/10/2110 | 7.832.506 |
| 10.732.000 | Serbia International Bond, 1.65%, 03/03/2033 | 7.777.166 |
| 19.045.739 | Ecuador Government International Bond, 3.50%, 31/07/2035 | 6.829.418 |
| 8.035.000 | Brazilian Government International Bond, 5.63%, 21/02/2047 | 6.593.288 |
| 6.785.000 | Romanian Government International Bond, 3.62%, 26/05/2030 | 6.387.215 |
| 10.267.000 | El Salvador Government International Bond, 9.50%, 15/07/2052 | 6.329.536 |
| 6.950.000 | Republic of Armenia International Bond, 3.95%, 26/09/2029 | 5.775.700 |
| 17.900.785 | Argentine Republic Government International Bond, 0.75%, 09/07/2030 | 5.545.816 |
| 4.956.000 | Panama Government International Bond, 6.40%, 14/02/2035 | 5.169.653 |
| 7.630.000 | Ghana Government International Bond, 10.75%, 14/10/2030 | 5.132.707 |
| 5.700.000 | Chile Government International Bond, 3.50%, 31/01/2034 | 5.021.245 |
| 4.759.000 | Costa Rica Government International Bond, 6.55%, 03/04/2034 | 4.790.132 |
| 4.110.000 | Hungary Government International Bond, 7.63%, 29/03/2041 | 4.706.266 |
| 4.438.000 | Peruvian Government International Bond, 3.75%, 01/03/2030 | 4.705.852 |
| 5.843.000 | Peruvian Government International Bond, 1.95%, 17/11/2036 | 4.601.609 |
| 5.160.000 | Romanian Government International Bond, 3.88%, 29/10/2035 | 4.525.939 |
| 4.391.000 | Türkiye Government International Bond, 9.13%, 13/07/2030 | 4.391.751 |
| 4.225.000 | Panama Government International Bond, 6.85%, 28/03/2054 | 4.345.906 |
| 5.400.000 | Mexico Government International Bond, 2.25%, 12/08/2036 | 4.296.966 |
| 5.440.000 | Dominican Republic International Bond, 5.88%, 30/01/2060 | 4.270.387 |
| 4.180.000 | Costa Rica Government International Bond, 7.16%, 12/03/2045 | 4.176.121 |
| 7.733.000 | El Salvador Government International Bond, 7.65%, 15/06/2035 | 4.163.440 |
| 5.040.000 | Romanian Government International Bond, 4.63%, 03/04/2049 | 4.134.243 |

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|------------|---|-------------|
| 15.555.000 | Oman Government International Bond, 6.75%, 17/01/2048 | 14.092.617 |
| 25.052.412 | Ecuador Government International Bond, 3.50%, 31/07/2035 | 8.743.288 |
| 6.900.000 | Morocco Government International Bond, 5.50%, 11/12/2042 | 5.963.093 |
| 6.125.000 | Panama Government International Bond, 6.40%, 14/02/2035 | 5.928.929 |
| 5.730.000 | Oman Government International Bond, 6.25%, 25/01/2031 | 5.626.756 |
| 4.890.000 | Uruguay Government International Bond, 4.38%, 23/01/2031 | 4.777.537 |
| 5.526.000 | Romanian Government International Bond, 4.63%, 03/04/2049 | 4.700.377 |
| 5.680.000 | Chile Government International Bond, 2.55%, 27/07/2033 | 4.608.970 |
| 4.391.000 | Türkiye Government International Bond, 9.13%, 13/07/2030 | 4.368.554 |
| 4.110.000 | Hungary Government International Bond, 7.63%, 29/03/2041 | 4.311.429 |
| 15.562.273 | Argentine Republic Government International Bond, 3.63%, 09/07/2035 | 4.217.706 |
| 3.870.000 | Republic of Uzbekistan International Bond, 4.75%, 20/02/2024 | 3.832.925 |
| 4.225.000 | Panama Government International Bond, 6.85%, 28/03/2054 | 3.829.963 |
| 4.730.000 | Brazilian Government International Bond, 5.63%, 21/02/2047 | 3.775.691 |
| 3.943.000 | Republic of Uzbekistan International Bond, 5.38%, 20/02/2029 | 3.665.092 |
| 4.540.000 | Morocco Government International Bond, 3.00%, 15/12/2032 | 3.648.522 |
| 3.670.000 | Costa Rica Government International Bond, 7.16%, 12/03/2045 | 3.605.247 |
| 3.761.000 | Dominican Republic International Bond, 6.00%, 22/02/2033 | 3.436.314 |
| 4.140.000 | Peruvian Government International Bond, 3.00%, 15/01/2034 | 3.378.760 |
| 2.593.000 | Republic of Poland Government International Bond, 5.50%, 04/04/2053 | 2.599.722 |
| 2.473.000 | Morocco Government International Bond, 6.50%, 08/09/2033 | 2.551.897 |
| 2.410.000 | UAE International Government Bond, 4.95%, 07/07/2052 | 2.362.282 |
| 2.415.000 | Panama Government International Bond, 6.70%, 26/01/2036 | 2.356.074 |
| 2.450.000 | Colombia Government International Bond, 3.88%, 25/04/2027 | 2.326.841 |
| 4.467.410 | Ecuador Government International Bond, 6.00%, 31/07/2030 | 2.138.269 |
| 2.300.000 | Brazilian Government International Bond, 5.63%, 07/01/2041 | 2.042.134 |
| 2.958.000 | Panama Government International Bond, 4.50%, 01/04/2056 | 1.919.063 |
| 1.810.000 | Republic of Poland Government International Bond, 5.75%, 16/11/2032 | 1.899.417 |
| 2.090.000 | Romanian Government International Bond, 3.88%, 29/10/2035 | 1.815.239 |
| 2.309.000 | Hungary Government International Bond, 1.75%, 05/06/2035 | 1.793.177 |

Tactical Macro – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Käufe insgesamt:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|------------|--|-------------|
| 12.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 30/01/2024 | 11.924.693 |
| 7.500.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 21/11/2023 | 7.379.206 |
| 5.200.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 15/02/2024 | 5.157.946 |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 21/09/2023 | 4.947.567 |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 06/02/2024 | 4.923.300 |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 24/10/2023 | 4.923.224 |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 14/03/2024 | 4.914.450 |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 16/01/2024 | 4.914.168 |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 18/04/2024 | 4.892.957 |
| 4.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 16/11/2023 | 3.946.001 |
| 3.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 16/05/2024 | 2.923.660 |
| 547.700 | United States Treasury Bill, 0.00%, 05/03/2024 | 541.840 |
| 548.800 | United States Treasury Bill, 0.00%, 19/03/2024 | 541.831 |

Verkäufe insgesamt:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|-----------|--|-------------|
| 5.194.200 | United States Treasury Bill, 0.00%, 30/01/2024 | 5.164.103 |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 14/03/2024 | 4.927.465 |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 18/04/2024 | 4.903.034 |
| 3.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 16/05/2024 | 2.930.182 |

Ultra Short Term Euro Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten EUR |
|------------|--|------------|
| 23.000.000 | Federation des Caisses Desjardins du Quebec, 2.88%, 28/11/2024 | 22.816.000 |
| 23.000.000 | Aegon Bank NV, 0.38%, 21/11/2024 | 22.249.092 |
| 15.000.000 | Sumitomo Mitsui Banking Corp, 3.60%, 16/02/2026 | 14.948.874 |
| 15.000.000 | Bank of Nova Scotia, 3.05%, 31/10/2024 | 14.865.900 |
| 14.000.000 | Credit Mutuel Home Loan SFH SA, 0.63%, 10/02/2025 | 13.440.660 |
| 13.000.000 | Australia & New Zealand Banking Group Ltd, 3.44%, 04/04/2025 | 12.954.790 |
| 12.000.000 | Toronto-Dominion Bank, 3.77%, 08/09/2026 | 11.998.548 |
| 11.400.000 | Traton Finance Luxembourg SA, 4.13%, 18/01/2025 | 11.340.300 |
| 11.000.000 | Credit Agricole Home Loan SFH SA, 0.38%, 30/09/2024 | 10.625.620 |
| 10.026.000 | Islandsbanki HF, 7.38%, 17/05/2026 | 10.395.258 |
| 10.000.000 | Westpac Banking Corp, 3.46%, 04/04/2025 | 10.004.890 |
| 10.000.000 | Lloyds Bank Plc, 3.25%, 02/02/2026 | 9.948.440 |
| 9.839.765 | Dutch Property Finance BV Series 2021-2 Class A, 4.65%, 28/04/2059 | 9.782.694 |
| 10.000.000 | NatWest Group Plc, 1.75%, 02/03/2026 | 9.618.000 |
| 10.000.000 | Canadian Imperial Bank of Commerce, 0.38%, 10/03/2026 | 9.214.700 |
| 9.000.000 | Finland T-Bill, 0.00%, 13/02/2024 | 8.792.007 |
| 9.000.000 | BPCE SFH SA, 0.13%, 31/03/2025 | 8.462.160 |
| 8.800.000 | Credit Agricole Home Loan SFH SA, 0.13%, 16/12/2024 | 8.439.240 |
| 8.000.000 | Banco Santander SA, 0.10%, 26/01/2025 | 7.954.000 |
| 8.300.000 | US Bancorp, 0.85%, 07/06/2024 | 7.953.551 |

Ultra Short Term Euro Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse EUR |
|------------|--|------------|
| 16.900.000 | Goldman Sachs Group Inc, 1.38%, 15/05/2024 | 16.562.790 |
| 11.300.000 | Toronto-Dominion Bank, 3.77%, 08/09/2026 | 11.452.443 |
| 10.000.000 | Danske Bank A/S, 0.01%, 10/11/2024 | 9.959.250 |
| 9.000.000 | ALD SA, 1.25%, 02/03/2026 | 8.347.654 |
| 8.000.000 | Barclays Plc, 3.38%, 02/04/2025 | 7.931.620 |
| 8.084.000 | Commerzbank AG, 0.10%, 11/09/2025 | 7.518.035 |
| 7.430.000 | European Financial Stability Facility, 3.50%, 11/04/2029 | 7.427.771 |
| 7.000.000 | Smurfit Kappa Acquisitions ULC, 2.88%, 15/01/2026 | 6.883.080 |
| 6.819.490 | MIRAVET Sarl Series 2019-1 Class A, 4.71%, 26/05/2065 | 6.737.833 |
| 6.770.000 | Heimstaden Bostad AB, 2.13%, 05/09/2023 | 6.652.291 |
| 6.000.000 | Nationale-Niederlanden Bank NV, 1.00%, 25/09/2028 | 5.447.070 |
| 5.100.000 | Federation des Caisses Desjardins du Quebec, 3.25%, 18/04/2028 | 5.081.988 |
| 5.000.000 | Lloyds Bank Plc, 3.25%, 02/02/2026 | 5.018.500 |
| 5.300.000 | Bayer AG, 0.05%, 12/01/2025 | 4.983.590 |
| 5.000.000 | Canadian Imperial Bank of Commerce, 0.38%, 10/03/2026 | 4.711.750 |
| 4.820.000 | Slovakia Government Bond, 3.75%, 23/02/2035 | 4.684.200 |
| 5.000.000 | NatWest Markets Plc, 0.13%, 12/11/2025 | 4.606.985 |
| 5.000.000 | UniCredit SpA, 0.33%, 19/01/2026 | 4.543.000 |
| 4.400.000 | Croatia Government International Bond, 4.00%, 14/06/2035 | 4.492.035 |
| 4.250.000 | Nationwide Building Society, 4.50%, 01/11/2026 | 4.269.763 |

Uncorrelated Strategies – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|-------------|--|-------------|
| 1.128.426 | Dr ING hc F Porsche AG | 138.213.886 |
| 130.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 17/10/2023 | 128.067.935 |
| 125.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 16/01/2024 | 124.086.632 |
| 125.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 01/02/2024 | 123.925.503 |
| 125.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 24/11/2023 | 123.811.832 |
| 125.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 15/02/2024 | 123.724.654 |
| 125.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 29/02/2024 | 123.379.774 |
| 125.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 05/07/2023 | 122.985.000 |
| 115.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 06/06/2023 | 113.258.204 |
| 110.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 05/12/2023 | 109.222.373 |
| 110.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 09/01/2024 | 109.150.520 |
| 110.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 30/11/2023 | 108.965.120 |
| 110.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 16/11/2023 | 108.893.230 |
| 105.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 02/05/2023 | 103.435.935 |
| 105.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 13/06/2023 | 103.366.105 |
| 105.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 20/06/2023 | 103.345.974 |
| 100.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 04/01/2024 | 98.640.444 |
| 100.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 16/05/2023 | 98.511.500 |
| 100.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 22/06/2023 | 98.489.108 |
| 100.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 09/05/2023 | 98.485.667 |
| 100.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 27/06/2023 | 98.450.272 |
| 90.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 24/10/2023 | 89.031.525 |
| 85.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 31/10/2023 | 84.082.097 |
| 85.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 17/08/2023 | 83.648.875 |
| 80.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 07/11/2023 | 79.135.927 |
| 80.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 24/08/2023 | 78.830.584 |
| 80.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 01/08/2023 | 78.737.146 |
| 80.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 10/08/2023 | 78.646.413 |
| 70.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 23/05/2023 | 68.940.999 |
| 70.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 30/05/2023 | 68.927.397 |
| 60.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 31/08/2023 | 59.160.068 |

Uncorrelated Strategies – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Verkäufe insgesamt:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|-------------|--|-------------|
| 1.192.243 | Dr ING hc F Porsche AG | 146.198.495 |
| 105.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 02/05/2023 | 104.935.731 |
| 100.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 16/05/2023 | 99.940.867 |
| 90.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 24/10/2023 | 89.920.793 |
| 85.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 31/10/2023 | 84.837.565 |
| 75.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 27/04/2023 | 74.976.259 |
| 70.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 01/08/2023 | 69.782.496 |
| 60.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 07/11/2023 | 59.859.787 |
| 45.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 30/05/2023 | 44.983.873 |
| 21.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 17/10/2023 | 20.981.547 |
| 20.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 09/05/2023 | 19.974.517 |
| 17.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 23/05/2023 | 16.980.617 |
| 10.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 13/04/2023 | 9.991.917 |

Uncorrelated Trading – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|---------------|--|-------------|
| 48.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 09/05/2023 | 47.273.120 |
| 47.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 13/06/2023 | 46.268.638 |
| 45.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 30/03/2023 | 44.549.925 |
| 41.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 06/06/2023 | 40.379.012 |
| 40.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 23/05/2023 | 39.394.857 |
| 24.000.000 | Siemens Energy Finance BV, 5.63%, 14/09/2025 | 35.087.468 |
| 30.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 16/05/2023 | 29.553.450 |
| 16.500.000 | Palo Alto Networks Inc, 0.38%, 01/06/2025 | 27.941.707 |
| 2.480.000.000 | ANA Holdings Inc, 0.00%, 10/12/2031 | 20.443.011 |
| 20.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 30/05/2023 | 19.693.542 |
| 20.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 27/06/2023 | 19.690.054 |
| 966.454 | Volvo AB | 19.309.920 |
| 1.788.123 | Deutsche Lufthansa AG | 18.944.704 |
| 14.700.000 | Deutsche Lufthansa AG, 2.00%, 17/11/2025 | 17.978.801 |
| 15.800.000 | Sasol Financing USA LLC, 4.50%, 08/11/2027 | 16.913.853 |
| 115.833 | Safran SA | 16.622.731 |
| 16.200.000 | Live Nation Entertainment Inc, 3.13%, 15/01/2029 | 16.324.209 |
| 101.262 | Siemens AG | 15.830.224 |
| 11.461.000 | Safran SA, 0.88%, 15/05/2027 | 15.082.689 |
| 15.800.000 | Dufry One BV, 0.75%, 30/03/2026 | 14.749.192 |

Uncorrelated Trading - Hard Currency – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|---------------|--|-------------|
| 47.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 08/06/2023 | 46.880.087 |
| 47.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 13/06/2023 | 46.849.332 |
| 29.400.000 | Siemens Energy Finance BV, 5.63%, 14/09/2025 | 45.327.951 |
| 41.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 06/06/2023 | 40.907.674 |
| 16.500.000 | Palo Alto Networks Inc, 0.38%, 01/06/2025 | 32.177.849 |
| 3.870.000.000 | ANA Holdings Inc, 0.00%, 10/12/2031 | 31.554.679 |
| 21.500.000 | Deutsche Lufthansa AG, 2.00%, 17/11/2025 | 26.831.904 |
| 2.390.219 | Deutsche Lufthansa AG | 25.303.215 |
| 1.240.354 | Volvo AB | 24.835.786 |
| 23.200.000 | Sasol Financing USA LLC, 4.50%, 08/11/2027 | 24.347.278 |
| 24.800.000 | Dufry One BV, 0.75%, 30/03/2026 | 23.524.721 |
| 150.399 | Safran SA | 21.685.835 |
| 20.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 30/05/2023 | 19.984.672 |
| 20.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 27/06/2023 | 19.896.079 |
| 13.400.000 | Safran SA, 0.88%, 15/05/2027 | 18.621.023 |
| 142.659 | Dr ING hc F Porsche AG | 17.476.232 |
| 107.740 | Siemens AG | 16.872.187 |
| 15.400.000 | ELM BV for Swiss Re Ltd, 3.25%, 13/06/2024 | 16.552.561 |
| 21.300.000 | ams-OSRAM AG, 2.13%, 03/11/2027 | 16.157.884 |
| 8.612.639 | Melrose Industries Plc | 16.121.277 |

US Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|---------|---|-------------|
| 5.059 | Microsoft Corp | 1.478.326 |
| 9.222 | Amazon.com Inc | 1.079.116 |
| 25.230 | Match Group Inc | 1.026.379 |
| 6.653 | Dollar Tree Inc | 940.653 |
| 3.338 | NVIDIA Corp | 937.726 |
| 1.687 | Intuit Inc | 768.604 |
| 29.438 | Chewy Inc Class A | 739.938 |
| 3.450 | Salesforce Inc | 637.252 |
| 4.705 | Progressive Corp | 624.990 |
| 4.906 | Alphabet Inc Class A | 599.108 |
| 1.306 | Netflix Inc | 521.556 |
| 7.440 | NextEra Energy Inc | 497.602 |
| 2.528 | Workday Inc Class A | 487.805 |
| 3.170 | AbbVie Inc | 485.754 |
| 2.719 | Analog Devices Inc | 479.050 |
| 1.719 | McDonald's Corp | 468.513 |
| 933 | UnitedHealth Group Inc | 455.894 |
| 984 | ServiceNow Inc | 453.413 |
| 13.566 | Keurig Dr Pepper Inc | 447.377 |
| 1.568 | Meta Platforms Inc Class A | 423.461 |
| 5.074 | TJX Cos Inc | 413.326 |
| 1.985 | Equifax Inc | 386.904 |
| 2.432 | Johnson & Johnson | 384.684 |
| 11.301 | Brookfield Asset Management Ltd Class A | 368.820 |
| 1.527 | Visa Inc Class A | 354.794 |
| 4.826 | Okta Inc Class A | 343.956 |
| 1.969 | Apple Inc | 332.138 |
| 2.033 | Walmart Inc | 309.313 |
| 791 | Mastercard Inc Class A | 303.980 |
| 2.306 | TE Connectivity Ltd | 294.007 |
| 1.299 | Avery Dennison Corp | 222.974 |
| 487 | Adobe Inc | 218.250 |

US Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|---------|---------------------------------|-------------|
| 6.930 | Apple Inc | 1.167.596 |
| 3.645 | Microsoft Corp | 1.148.302 |
| 1.414 | ServiceNow Inc | 773.172 |
| 1.770 | NVIDIA Corp | 748.857 |
| 6.259 | Alphabet Inc Class A | 641.427 |
| 2.468 | Salesforce Inc | 507.696 |
| 2.133 | SBA Communications Corp Class A | 476.355 |
| 1.240 | S&P Global Inc | 441.766 |
| 4.003 | Amazon.com Inc | 432.751 |
| 1.975 | CME Group Inc Class A | 392.778 |
| 745 | Adobe Inc | 375.641 |
| 1.050 | Home Depot Inc | 327.657 |
| 2.792 | Walt Disney Co | 294.571 |
| 1.171 | Meta Platforms Inc Class A | 280.374 |
| 2.424 | NIKE Inc Class B | 275.219 |
| 513 | Costco Wholesale Corp | 273.291 |
| 3.212 | TJX Cos Inc | 266.805 |
| 1.830 | TE Connectivity Ltd | 250.561 |
| 1.259 | Analog Devices Inc | 243.791 |
| 10.122 | Chewy Inc Class A | 232.904 |
| 948 | Equifax Inc | 209.937 |
| 5.713 | Brookfield Corp | 203.510 |
| 9.805 | Kenvue Inc | 194.418 |
| 806 | Union Pacific Corp | 163.034 |
| 1.311 | Dollar Tree Inc | 154.234 |
| 2.112 | Okta Inc Class A | 153.224 |
| 424 | Netflix Inc | 148.675 |
| 808 | CDW Corp | 146.843 |
| 606 | Workday Inc Class A | 144.829 |
| 534 | Visa Inc Class A | 123.783 |

US Equity Index PutWrite – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Käufe insgesamt:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|------------|---|-------------|
| 82.300.000 | United States Treasury Note/Bond, 3.50%, 15/09/2025 | 79.954.637 |
| 82.300.000 | United States Treasury Note/Bond, 2.88%, 15/06/2025 | 79.515.348 |
| 79.500.000 | United States Treasury Note/Bond, 4.00%, 15/12/2025 | 78.869.590 |
| 80.700.000 | United States Treasury Note/Bond, 1.75%, 15/03/2025 | 76.809.094 |

Verkäufe insgesamt:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|------------|---|-------------|
| 72.200.000 | United States Treasury Note/Bond, 0.50%, 15/03/2023 | 71.683.883 |
| 20.000.000 | United States Treasury Note/Bond, 0.13%, 15/12/2023 | 19.792.188 |

US Large Cap Value – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|-----------|--------------------------------------|-------------|
| 437.517 | Johnson & Johnson | 70.755.635 |
| 212.715 | Becton Dickinson & Co | 55.047.813 |
| 1.249.210 | Exelon Corp | 50.430.044 |
| 530.954 | Duke Energy Corp | 49.070.277 |
| 335.724 | Procter & Gamble Co | 48.702.971 |
| 314.031 | Walmart Inc | 48.098.042 |
| 578.307 | Gilead Sciences Inc | 46.826.911 |
| 1.169.858 | Pfizer Inc | 40.586.950 |
| 120.547 | Berkshire Hathaway Inc Class B | 39.248.493 |
| 736.837 | Kroger Co | 35.102.050 |
| 315.787 | DTE Energy Co | 33.959.342 |
| 387.100 | Medtronic Plc | 32.358.835 |
| 305.959 | Sempra | 31.859.979 |
| 57.912 | UnitedHealth Group Inc | 30.672.367 |
| 444.186 | Mondelez International Inc Class A | 30.421.924 |
| 363.923 | American Electric Power Co Inc | 30.347.419 |
| 108.978 | McDonald's Corp | 29.881.284 |
| 760.909 | Verizon Communications Inc | 29.657.075 |
| 409.477 | Rio Tinto Plc ADR | 29.639.277 |
| 600.446 | Boston Scientific Corp | 28.535.073 |
| 109.630 | Amgen Inc | 27.936.750 |
| 891.992 | Bank of America Corp | 27.878.702 |
| 98.172 | Stryker Corp | 27.533.225 |
| 616.039 | Freeport-McMoRan Inc | 25.623.143 |
| 226.110 | ConocoPhillips | 25.199.626 |
| 461.370 | Las Vegas Sands Corp | 25.054.050 |
| 104.751 | Danaher Corp | 25.018.689 |
| 833.666 | CenterPoint Energy Inc | 22.966.681 |
| 673.412 | Truist Financial Corp | 22.761.114 |
| 150.213 | International Business Machines Corp | 22.629.763 |
| 564.711 | Comcast Corp Class A | 22.213.948 |
| 112.914 | CME Group Inc Class A | 22.043.215 |
| 123.457 | PepsiCo Inc | 21.676.303 |
| 200.339 | Merck & Co Inc | 21.436.095 |
| 71.481 | Air Products & Chemicals Inc | 21.136.598 |
| 333.271 | Public Service Enterprise Group Inc | 21.083.505 |
| 278.278 | CVS Health Corp | 20.653.016 |
| 405.875 | Citigroup Inc | 19.722.008 |
| 78.554 | Illinois Tool Works Inc | 19.559.696 |
| 148.007 | PNC Financial Services Group Inc | 19.193.803 |
| 345.761 | Agnico Eagle Mines Ltd | 18.485.023 |

US Large Cap Value – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|-----------|--------------------------------------|-------------|
| 1.678.140 | Bank of America Corp | 52.630.154 |
| 336.392 | Chevron Corp | 50.665.487 |
| 193.481 | Cummins Inc | 44.417.447 |
| 227.801 | PepsiCo Inc | 38.850.186 |
| 604.709 | NextEra Energy Inc | 37.616.547 |
| 99.520 | Berkshire Hathaway Inc Class B | 34.939.895 |
| 318.088 | ConocoPhillips | 34.534.629 |
| 148.546 | Constellation Brands Inc Class A | 33.566.402 |
| 647.221 | Boston Scientific Corp | 33.305.321 |
| 227.203 | JPMorgan Chase & Co | 32.894.440 |
| 295.320 | Exxon Mobil Corp | 32.117.584 |
| 366.273 | Emerson Electric Co | 31.609.550 |
| 351.661 | RTX Corp | 31.584.676 |
| 838.672 | Freeport-McMoRan Inc | 31.032.980 |
| 134.928 | Caterpillar Inc | 30.504.772 |
| 108.978 | McDonald's Corp | 30.180.671 |
| 60.475 | Humana Inc | 29.048.688 |
| 264.450 | Oracle Corp | 28.574.737 |
| 387.100 | Medtronic Plc | 28.472.682 |
| 848.870 | Keurig Dr Pepper Inc | 27.755.012 |
| 172.835 | Johnson & Johnson | 27.512.544 |
| 733.618 | Truist Financial Corp | 25.378.626 |
| 255.194 | Morgan Stanley | 24.320.227 |
| 51.136 | Lockheed Martin Corp | 23.049.639 |
| 48.398 | Elevance Health Inc | 22.943.373 |
| 28.482 | Regeneron Pharmaceuticals Inc | 22.902.121 |
| 72.789 | Parker-Hannifin Corp | 22.377.239 |
| 110.849 | Honeywell International Inc | 21.578.622 |
| 325.938 | Rio Tinto Plc ADR | 20.946.610 |
| 174.895 | Walt Disney Co | 19.055.219 |
| 187.889 | General Electric Co | 18.586.129 |
| 292.309 | Johnson Controls International Plc | 18.457.851 |
| 78.554 | Illinois Tool Works Inc | 18.227.192 |
| 272.126 | MetLife Inc | 17.483.267 |
| 129.705 | International Business Machines Corp | 17.315.371 |
| 47.154 | Goldman Sachs Group Inc | 17.249.129 |
| 107.988 | Walmart Inc | 16.920.733 |
| 110.395 | Procter & Gamble Co | 16.473.876 |
| 71.222 | Danaher Corp | 16.456.810 |
| 826.616 | Regions Financial Corp | 16.238.453 |

US Long Short Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|---------|--------------------------------|-------------|
| 27.693 | Dollar Tree Inc | 3.613.810 |
| 74.339 | Match Group Inc | 2.896.747 |
| 17.404 | Progressive Corp | 2.382.709 |
| 86.487 | Kenvue Inc | 2.163.253 |
| 81.790 | Chewy Inc Class A | 2.044.065 |
| 58.415 | Keurig Dr Pepper Inc | 1.944.150 |
| 28.076 | NextEra Energy Inc | 1.905.935 |
| 14.415 | Jacobs Solutions Inc | 1.745.950 |
| 3.443 | Intuit Inc | 1.685.936 |
| 2.104 | Equinix Inc | 1.644.879 |
| 13.525 | Amazon.com Inc | 1.611.733 |
| 44.424 | FirstEnergy Corp | 1.590.295 |
| 102.578 | Celebration Bidco Holdings LLC | 1.538.670 |
| 17.014 | WEC Energy Group Inc | 1.482.247 |
| 10.458 | JPMorgan Chase & Co | 1.430.992 |
| 7.611 | Chevron Corp | 1.207.509 |
| 70.264 | Paramount Global Class B | 1.141.298 |
| 16.900 | TransUnion | 1.119.447 |
| 17.441 | Apollo Global Management Inc | 1.074.734 |
| 3.816 | McDonald's Corp | 1.035.604 |
| 2.419 | Netflix Inc | 1.021.326 |
| 3.131 | NVIDIA Corp | 935.907 |
| 1.649 | Thermo Fisher Scientific Inc | 908.996 |
| 2.559 | Goldman Sachs Group Inc | 884.092 |
| 11.330 | TJX Cos Inc | 881.074 |
| 4.536 | Equifax Inc | 839.103 |
| 20.909 | Enbridge Inc | 771.537 |
| 2.380 | Meta Platforms Inc Class A | 684.302 |
| 17.596 | Foot Locker Inc | 670.638 |
| 3.509 | Salesforce Inc | 661.608 |
| 2.337 | Microsoft Corp | 641.754 |
| 17.867 | Brookfield Corp | 628.000 |
| 9.033 | Freshpet Inc | 593.758 |
| 3.977 | Walmart Inc | 592.904 |
| 5.977 | Lamb Weston Holdings Inc | 589.367 |

US Long Short Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|---------|--|-------------|
| 24.026 | Apple Inc | 4.131.807 |
| 16.195 | Meta Platforms Inc Class A | 4.078.929 |
| 6.820 | Adobe Inc | 3.386.211 |
| 46.470 | Apollo Global Management Inc | 3.360.928 |
| 10.140 | Microsoft Corp | 3.264.823 |
| 26.171 | Amazon.com Inc | 3.108.442 |
| 13.833 | Salesforce Inc | 2.887.670 |
| 73.622 | Enbridge Inc | 2.473.749 |
| 6.077 | S&P Global Inc | 2.200.238 |
| 30.016 | NextEra Energy Inc | 2.059.562 |
| 14.511 | TE Connectivity Ltd | 1.898.214 |
| 14.020 | Dollar Tree Inc | 1.803.036 |
| 3.005 | ServiceNow Inc | 1.765.653 |
| 19.634 | TJX Cos Inc | 1.723.954 |
| 6.966 | Equifax Inc | 1.607.203 |
| 7.295 | CME Group Inc Class A | 1.590.881 |
| 2.744 | Costco Wholesale Corp | 1.555.095 |
| 32.249 | nVent Electric Plc | 1.460.180 |
| 27.799 | Fidelity National Information Services Inc | 1.452.855 |
| 6.517 | Union Pacific Corp | 1.449.591 |
| 7.561 | Analog Devices Inc | 1.441.330 |
| 883.014 | Anagram Holdings LLC/Anagram International Inc, 15.00%, 15/08/2025 | 1.410.556 |
| 60.653 | Kenvue Inc | 1.385.319 |
| 9.326 | JPMorgan Chase & Co | 1.334.116 |
| 12.842 | Walt Disney Co | 1.313.471 |
| 9.829 | Alphabet Inc Class A | 1.239.700 |
| 7.708 | Progressive Corp | 1.171.422 |
| 7.105 | Procter & Gamble Co | 1.068.996 |
| 1.854 | UnitedHealth Group Inc | 980.537 |
| 3.079 | Home Depot Inc | 971.923 |
| 8.081 | NIKE Inc Class B | 945.550 |
| 4.038 | CDW Corp | 881.749 |
| 10.434 | Ashland Inc | 879.664 |

US Multi Cap Opportunities – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|---------|-----------------------------------|-------------|
| 86.000 | EOG Resources Inc | 10.342.721 |
| 32.000 | Verisk Analytics Inc Class A | 5.754.651 |
| 33.000 | Avery Dennison Corp | 5.721.378 |
| 78.000 | TransUnion | 5.546.456 |
| 47.000 | Oracle Corp | 4.950.177 |
| 26.000 | Dollar Tree Inc | 3.801.155 |
| 50.000 | Veralto Corp | 3.623.270 |
| 23.000 | Electronic Arts Inc | 2.882.438 |
| 29.800 | RTX Corp | 2.575.882 |
| 63.000 | Simply Good Foods Co | 2.242.428 |
| 60.000 | Aramark | 1.730.580 |
| 40.000 | Brookfield Corp | 1.315.145 |
| 7.400 | WD-40 Co | 1.274.002 |
| 75.000 | Vestis Corp | 1.154.729 |
| 8.800 | QUALCOMM Inc | 1.139.786 |
| 5.000 | HCA Healthcare Inc | 1.128.190 |
| 23.800 | Brookfield Renewable Corp Class A | 739.217 |
| 2.400 | Becton Dickinson & Co | 580.922 |
| 2.000 | Nordson Corp | 439.280 |
| 16.400 | Graphic Packaging Holding Co | 383.752 |

US Multi Cap Opportunities – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|---------|---|-------------|
| 125.000 | RTX Corp | 12.405.764 |
| 60.000 | Electronic Arts Inc | 7.995.480 |
| 60.000 | Dollar Tree Inc | 6.813.715 |
| 25.000 | HCA Healthcare Inc | 6.727.073 |
| 30.000 | Sherwin-Williams Co | 6.616.771 |
| 19.000 | Berkshire Hathaway Inc Class B | 6.259.969 |
| 22.000 | Motorola Solutions Inc | 6.141.664 |
| 47.300 | Alphabet Inc Class C | 5.687.053 |
| 32.000 | Apple Inc | 5.462.376 |
| 66.300 | Columbia Sportswear Co | 5.425.567 |
| 44.000 | NIKE Inc Class B | 5.086.624 |
| 14.600 | Microsoft Corp | 4.653.098 |
| 141.300 | Pfizer Inc | 4.616.241 |
| 108.300 | US Foods Holding Corp | 4.381.397 |
| 56.700 | Charles Schwab Corp | 4.151.191 |
| 18.500 | Lowe's Cos Inc | 3.949.870 |
| 25.200 | JPMorgan Chase & Co | 3.815.712 |
| 51.700 | BJ's Wholesale Club Holdings Inc | 3.757.828 |
| 155.000 | Graphic Packaging Holding Co | 3.706.069 |
| 38.100 | Lamb Weston Holdings Inc | 3.668.197 |
| 109.000 | CSX Corp | 3.527.807 |
| 11.400 | McDonald's Corp | 3.303.963 |
| 103.825 | Brookfield Asset Management Ltd Class A | 3.256.259 |
| 58.000 | Ball Corp | 3.232.886 |
| 1.100 | Booking Holdings Inc | 3.139.757 |
| 20.000 | Eagle Materials Inc | 3.125.498 |
| 37.800 | Apollo Global Management Inc | 3.093.384 |
| 19.200 | T-Mobile US Inc | 2.988.494 |
| 80.300 | Brookfield Corp | 2.942.318 |
| 30.200 | TJX Cos Inc | 2.591.078 |
| 62.500 | Aramark | 2.552.300 |
| 31.000 | Brunswick Corp | 2.515.065 |
| 26.900 | Walt Disney Co | 2.477.600 |
| 30.200 | Mondelez International Inc Class A | 2.149.251 |
| 10.000 | Chubb Ltd | 2.113.340 |
| 15.000 | EOG Resources Inc | 1.918.284 |
| 69.500 | Brookfield Renewable Corp Class A | 1.802.859 |
| 7.300 | Nordson Corp | 1.723.938 |

US Real Estate Securities – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|-----------|---------------------------------|-------------|
| 41.239 | Equinix Inc | 30.453.161 |
| 542.845 | VICI Properties Inc Class A | 17.576.334 |
| 184.332 | Realty Income Corp | 11.822.757 |
| 1.895.328 | Hudson Pacific Properties Inc | 11.687.209 |
| 56.364 | AvalonBay Communities Inc | 9.727.715 |
| 33.222 | Public Storage | 9.426.060 |
| 44.752 | American Tower Corp | 8.406.395 |
| 258.168 | Omega Healthcare Investors Inc | 8.195.886 |
| 28.710 | SBA Communications Corp Class A | 7.172.044 |
| 52.986 | Crown Castle Inc | 6.885.506 |
| 48.557 | Sun Communities Inc | 6.353.401 |
| 116.813 | Boston Properties Inc | 6.242.817 |
| 212.958 | Weyerhaeuser Co | 6.135.076 |
| 383.208 | Urban Edge Properties | 5.793.659 |
| 50.128 | Simon Property Group Inc | 5.692.846 |
| 77.299 | Equity LifeStyle Properties Inc | 5.041.087 |
| 124.381 | Invitation Homes Inc | 4.085.130 |
| 206.745 | Kimco Realty Corp | 3.788.638 |
| 111.683 | Apartment Income REIT Corp | 3.764.655 |
| 24.956 | Extra Space Storage Inc | 3.062.979 |
| 48.166 | Iron Mountain Inc | 2.671.652 |
| 22.566 | Prologis Inc | 2.597.734 |

US Real Estate Securities – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|-----------|---------------------------------|-------------|
| 227.876 | Digital Realty Trust Inc | 21.620.456 |
| 159.448 | Prologis Inc | 19.483.774 |
| 92.653 | American Tower Corp | 18.139.685 |
| 24.453 | Equinix Inc | 17.965.554 |
| 53.392 | Public Storage | 15.197.015 |
| 264.310 | Realty Income Corp | 14.875.485 |
| 186.562 | Welltower Inc | 14.637.481 |
| 122.843 | Crown Castle Inc | 14.304.964 |
| 239.399 | Iron Mountain Inc | 14.161.812 |
| 328.008 | UDR Inc | 13.396.129 |
| 345.861 | Invitation Homes Inc | 11.442.193 |
| 339.400 | VICI Properties Inc Class A | 10.365.422 |
| 538.564 | Healthpeak Properties Inc | 10.212.058 |
| 1.022.272 | Medical Properties Trust Inc | 10.129.056 |
| 146.860 | Equity LifeStyle Properties Inc | 9.764.888 |
| 153.464 | Equity Residential | 9.264.368 |
| 158.908 | Boston Properties Inc | 9.141.124 |
| 66.333 | Sun Communities Inc | 8.805.386 |
| 409.664 | Kimco Realty Corp | 8.366.381 |
| 45.715 | EastGroup Properties Inc | 8.126.633 |
| 226.961 | American Homes 4 Rent Class A | 8.010.555 |
| 192.153 | Spirit Realty Capital Inc | 7.495.440 |
| 32.826 | Essex Property Trust Inc | 7.231.514 |
| 223.754 | Weyerhaeuser Co | 7.061.285 |
| 53.721 | Simon Property Group Inc | 6.205.998 |
| 97.086 | Rexford Industrial Realty Inc | 5.819.171 |
| 39.959 | Extra Space Storage Inc | 5.628.658 |
| 160.172 | Apartment Income REIT Corp | 5.533.991 |
| 113.696 | Ventas Inc | 5.210.071 |
| 18.996 | SBA Communications Corp Class A | 4.595.055 |

US Small Cap – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|---------|-----------------------------------|-------------|
| 125.527 | Tidewater Inc | 5.526.299 |
| 66.785 | SPX Technologies Inc | 4.992.151 |
| 63.020 | Arcosa Inc | 4.749.192 |
| 34.658 | Standex International Corp | 4.658.935 |
| 12.869 | Winmark Corp | 4.150.126 |
| 56.908 | Shift4 Payments Inc Class A | 3.834.854 |
| 147.776 | Stevanato Group SpA | 3.642.618 |
| 141.191 | Sitio Royalties Corp Class A | 3.591.742 |
| 59.660 | ESAB Corp | 3.547.227 |
| 174.872 | Element Solutions Inc | 3.468.677 |
| 37.526 | QuidelOrtho Corp | 3.333.928 |
| 87.572 | Simply Good Foods Co | 3.228.912 |
| 31.175 | ESCO Technologies Inc | 3.121.303 |
| 73.808 | Amphastar Pharmaceuticals Inc | 3.086.079 |
| 149.617 | Oceaneering International Inc | 2.843.014 |
| 347.216 | Transocean Ltd | 2.740.274 |
| 47.318 | Stewart Information Services Corp | 2.161.529 |
| 44.347 | Cactus Inc Class A | 2.149.582 |
| 16.016 | Rogers Corp | 2.085.085 |
| 36.605 | Community Bank System Inc | 1.945.731 |
| 8.313 | Littelfuse Inc | 1.905.648 |
| 8.969 | CorVel Corp | 1.825.968 |
| 53.462 | United Community Banks Inc | 1.727.157 |
| 22.063 | Casella Waste Systems Inc Class A | 1.697.199 |
| 16.294 | Crane Co | 1.627.500 |
| 6.978 | Valmont Industries Inc | 1.617.289 |
| 13.623 | CRA International Inc | 1.572.473 |
| 54.313 | Driven Brands Holdings Inc | 1.502.397 |
| 21.962 | CommVault Systems Inc | 1.475.845 |
| 27.812 | AMERISAFE Inc | 1.460.703 |
| 27.138 | CBIZ Inc | 1.447.855 |
| 46.985 | Model N Inc | 1.316.292 |
| 159.502 | Hillman Solutions Corp | 1.308.143 |
| 7.186 | FTI Consulting Inc | 1.253.435 |
| 5.649 | Kadant Inc | 1.209.044 |
| 48.133 | First Financial Bankshares Inc | 1.182.868 |

US Small Cap – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|---------|---|-------------|
| 17.813 | West Pharmaceutical Services Inc | 6.420.708 |
| 47.238 | Chase Corp | 5.926.833 |
| 28.779 | Manhattan Associates Inc | 5.075.397 |
| 67.187 | Forward Air Corp | 4.908.464 |
| 92.496 | National Instruments Corp | 4.866.670 |
| 202.500 | Abcam Plc ADR | 4.510.964 |
| 5.452 | Fair Isaac Corp | 4.469.234 |
| 57.271 | BOK Financial Corp | 4.374.555 |
| 8.829 | IDEXX Laboratories Inc | 4.283.190 |
| 10.902 | Pool Corp | 3.886.714 |
| 251.567 | Driven Brands Holdings Inc | 3.849.591 |
| 70.684 | XPEL Inc | 3.607.511 |
| 112.053 | FormFactor Inc | 3.479.421 |
| 224.069 | CVB Financial Corp | 3.315.103 |
| 141.592 | NetScout Systems Inc | 3.228.259 |
| 16.153 | Quaker Chemical Corp | 3.043.244 |
| 31.589 | Church & Dwight Co Inc | 2.809.304 |
| 12.446 | Zebra Technologies Corp Class A | 2.576.441 |
| 14.719 | SPS Commerce Inc | 2.398.482 |
| 29.250 | Lattice Semiconductor Corp | 2.322.573 |
| 29.990 | MKS Instruments Inc | 2.233.692 |
| 20.032 | LCI Industries | 2.222.412 |
| 13.687 | Novanta Inc | 2.121.459 |
| 10.330 | WD-40 Co | 2.074.114 |
| 45.612 | Bank of Hawaii Corp | 2.058.432 |
| 20.158 | Fox Factory Holding Corp | 2.038.678 |
| 87.331 | Certara Inc | 2.013.263 |
| 171.792 | American Software Inc Class A | 1.932.724 |
| 23.321 | AAON Inc | 1.905.662 |
| 49.303 | Artisan Partners Asset Management Inc Class A | 1.904.931 |
| 11.590 | Jack Henry & Associates Inc | 1.701.240 |
| 8.697 | FTI Consulting Inc | 1.683.485 |

US Small Cap Intrinsic Value – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Kosten US\$ |
|---------|---|-------------|
| 59.166 | KBR Inc | 3.239.706 |
| 63.294 | Ciena Corp | 2.890.579 |
| 194.736 | Kyndryl Holdings Inc | 2.889.504 |
| 88.811 | Criteo SA ADR | 2.695.917 |
| 34.434 | Arcosa Inc | 2.355.079 |
| 84.332 | Viasat Inc | 2.298.085 |
| 42.211 | Devon Energy Corp | 2.213.319 |
| 76.940 | International Game Technology Plc | 2.098.287 |
| 97.814 | Semtech Corp | 2.047.395 |
| 28.618 | MACOM Technology Solutions Holdings Inc | 2.019.274 |
| 62.842 | Patterson Cos Inc | 1.864.256 |
| 129.808 | Hain Celestial Group Inc | 1.797.650 |
| 9.638 | Avery Dennison Corp | 1.741.680 |
| 19.906 | Crown Holdings Inc | 1.701.223 |
| 42.425 | Portland General Electric Co | 1.701.007 |
| 41.267 | New Jersey Resources Corp | 1.699.729 |
| 33.420 | Rambus Inc | 1.694.673 |
| 22.984 | Acadia Healthcare Co Inc | 1.693.271 |
| 40.928 | Integra LifeSciences Holdings Corp | 1.692.816 |
| 35.051 | Northwestern Energy Group Inc | 1.689.203 |
| 117.172 | Stratasys Ltd | 1.684.720 |
| 32.377 | ALLETE Inc | 1.682.244 |
| 15.764 | Atmos Energy Corp | 1.677.989 |
| 19.850 | Ormat Technologies Inc | 1.644.209 |
| 70.492 | Veeco Instruments Inc | 1.632.875 |
| 83.245 | Cleveland-Cliffs Inc | 1.509.278 |
| 210.262 | Under Armour Inc Class C | 1.486.693 |
| 155.429 | Lions Gate Entertainment Corp Class B | 1.480.642 |
| 33.189 | ODP Corp | 1.465.132 |
| 23.107 | AerCap Holdings NV | 1.404.902 |
| 77.798 | Resideo Technologies Inc | 1.361.641 |
| 4.480 | Molina Healthcare Inc | 1.338.210 |
| 47.900 | Vistra Corp | 1.315.914 |
| 386.389 | Conduent Inc | 1.280.829 |
| 97.993 | Patterson-UTI Energy Inc | 1.261.803 |
| 165.657 | Enviri Corp | 1.239.023 |
| 35.269 | Coherent Corp | 1.203.287 |
| 24.984 | TreeHouse Foods Inc | 1.190.922 |
| 67.357 | TechnipFMC Plc | 1.067.433 |
| 24.677 | AtriCure Inc | 1.053.698 |
| 18.270 | Texas Capital Bancshares Inc | 1.043.333 |

US Small Cap Intrinsic Value – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Verkäufe insgesamt:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Erlöse US\$ |
|---------|---|-------------|
| 106.334 | Rambus Inc | 5.274.510 |
| 54.380 | New Relic Inc | 4.715.622 |
| 8.355 | Valmont Industries Inc | 1.942.270 |
| 10.236 | Clean Harbors Inc | 1.695.802 |
| 188.368 | Chico's FAS Inc | 1.409.197 |
| 21.289 | KBR Inc | 1.260.292 |
| 116.084 | Huntington Bancshares Inc | 1.128.968 |
| 22.957 | Tempur Sealy International Inc | 966.306 |
| 48.162 | Cardiovascular Systems Inc | 961.335 |
| 27.243 | Spirit AeroSystems Holdings Inc Class A | 942.202 |
| 9.790 | Haemonetics Corp | 830.418 |
| 31.986 | BankUnited Inc | 703.789 |
| 72.094 | Sunstone Hotel Investors Inc | 697.313 |
| 8.211 | MACOM Technology Solutions Holdings Inc | 687.924 |
| 9.882 | Comerica Inc | 376.555 |
| 114.241 | Diebold Nixdorf Inc | 268.147 |

ANMERKUNGEN ZUM GEPRÜFTEN JAHRESABSCHLUSS

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

1. WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE

Die wesentlichen vom Fonds angewandten Bilanzierungsgrundsätze sind im Folgenden beschrieben:

Grundlage für die Aufstellung des Abschlusses

Der Jahresabschluss wurde in Übereinstimmung mit dem Financial Reporting Standard („FRS“) 102: „The financial reporting standard applicable in the UK and Republic of Ireland“ erstellt. Die in Irland allgemein anerkannten Bilanzierungsgrundsätze für die Erstellung von Abschlüssen, die ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild vermitteln, sind diejenigen, die von Chartered Accountants Irland veröffentlicht und vom Financial Reporting Council („FRC“) herausgegeben worden sind. Der Jahresabschluss wird ebenfalls in Übereinstimmung mit dem irischen Recht in Gestalt des Companies Act 2014 (in seiner geltenden Fassung) sowie den EG-Richtlinien über Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren („European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations, 2011“) (in ihrer geltenden Fassung) und dem Central Bank (Supervision and Enforcement) Act 2013 (Section 48(1)) (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2019 (die „OGAW-Vorschriften der Zentralbank“) erstellt.

Der Abschluss wird nach dem Anschaffungskostenprinzip erstellt, berichtigt um die erfolgswirksame Neubewertung finanzieller Vermögenswerte und finanzieller Verbindlichkeiten zum beizulegenden Zeitwert. Bewertungszeitpunkt ist Marktschluss am jeweiligen Handelstag. Der Handelstag ist jeder Geschäftstag oder sonstige Tag, den die Direktoren festlegen und der Verwaltungsstelle und den Anteilhabern im Voraus mitteilen. Das Direktorium hat die Fähigkeit des Fonds zur weiteren Unternehmensfortführung bewertet und hat sich vergewissert, dass der Fonds über die Ressourcen verfügt, um seine Geschäfte auf absehbare Zeit und für mindestens zwölf Monate ab dem Datum der Genehmigung dieses Abschlusses fortzuführen. Ferner sind den Direktoren keine wesentlichen Unsicherheiten bekannt, die erhebliche Zweifel an der Fähigkeit des Fonds zur Unternehmensfortführung wecken könnten. Der Abschluss wird daher auf der Grundlage der Unternehmensfortführung aufgestellt.

Das Format und bestimmte Passagen des Wortlauts des Abschlusses weichen in bestimmten Punkten von den im Companies Act von 2014 (in ihrer geltenden Fassung) und FRS 102 enthaltenen ab, so dass sie nach Auffassung der Direktoren den Charakter des Geschäfts des Fonds als Investmentfonds besser widerspiegeln. Der Fonds erfüllt die entsprechenden Kriterien, um von der für bestimmte offene Investmentgesellschaften nach FRS 102 möglichen Befreiung von der Erstellung einer Kapitalflussrechnung Gebrauch zu machen.

Die Aufstellung des Abschlusses in Übereinstimmung mit FRS 102 erfordert die Verwendung bestimmter kritischer Schätzungen bei der Rechnungslegung. Außerdem müssen die Direktoren bei der Anwendung der Bilanzierungsgrundsätze des Fonds ihr Ermessen ausüben. Die Bereiche, die ein höheres Maß an Ermessensspielraum oder Komplexität erfordern, oder solche Bereiche, in denen Annahmen und Schätzungen für den Abschluss bedeutungsvoll sind, wie die Besteuerung oder die Annahme der Unternehmensfortführung, werden in den folgenden Anmerkungen offengelegt. Angaben zu Unsicherheiten bei Annahmen und Schätzungen mit einem erheblichen Risiko daraus resultierender wesentlicher Berichtigungen der Buchwerte von Vermögenswerten und Verbindlichkeiten im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 sind in Anmerkung 12 enthalten und beziehen sich auf die Bestimmung des beizulegenden Zeitwerts anhand maßgeblicher nicht beobachtbarer Parameter.

Finanzvermögen und -verbindlichkeiten erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

(i) Klassifizierung

Der Fonds wendet die Bestimmungen zu Ausweis und Bewertung des Internationalen Rechnungslegungsstandards 9: „Financial Instruments“ („IFRS 9“) sowie die die Offenlegungs- und Darstellungspflichten des FRS 102 auf alle Finanzinstrumente an. Gemäß IFRS 9 klassifiziert der Fonds finanzielle Vermögenswerte beim erstmaligen Ansatz als zu fortgeschriebenen Anschaffungskosten oder erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet. Ein finanzieller Vermögenswert wird zu fortgeschriebenen Anschaffungskosten bewertet, wenn er beide der folgenden Bedingungen erfüllt und nicht als erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet eingestuft ist: (a) er wird im Rahmen eines Geschäftsmodells gehalten, dessen Ziel das Halten von Vermögenswerten zur Inanspruchnahme von Einnahmen ist; und (b) seine Vertragsbedingungen führen zu festgelegten Zeitpunkten zu Einnahmen, die ausschließlich Tilgung und Zinszahlungen sind (Solely payments of principal and interest, „SPPI“). Alle anderen finanziellen Vermögenswerte der Portfolios werden erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet. Der Fonds hat seine Anlagen als erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert zu bewertende finanzielle Vermögenswerte bzw. finanzielle Verbindlichkeiten klassifiziert. Sämtliche Derivate, die Nettoforderungen darstellen (positiver beizulegender Zeitwert), werden unter erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten ausgewiesen. Sämtliche Derivate, die Nettoverbindlichkeiten darstellen (negativer beizulegender Zeitwert), werden unter erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen.

Finanzielle Vermögenswerte, die nicht erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet werden, sind unter anderem bestimmte Beträge von Brokern und Verbindlichkeiten, die zu den fortgeschriebenen Anschaffungskosten bewertet werden.

Finanzielle Verbindlichkeiten, die nicht erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet werden, sind unter anderem bestimmte an Broker zahlbare Beträge und Verbindlichkeiten, die zu den fortgeschriebenen Anschaffungskosten bewertet werden.

(ii) Erstbewertung

Käufe und Verkäufe von Finanzinstrumenten werden in den Abschlüssen zum Handelsdatum verbucht. Realisierte Gewinne und Verluste aus Veräußerungen von Finanzinstrumenten werden anhand der „First in/First out“-Methode berechnet. Die Erstbewertung von Finanzinstrumenten, die als erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert zu bewertende finanzielle Vermögenswerte kategorisiert sind, erfolgt zum beizulegenden Zeitwert, und die Transaktionskosten für solche Wertpapiere werden direkt in der Gewinn- und Verlustrechnung erfasst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

1. WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE (FORTSETZUNG)

Finanzvermögen und -verbindlichkeiten erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

(iii) Folgebewertung

Nach der Erstbewertung bewertet der Fonds Finanzinstrumente, die als erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert zu bewertende finanzielle Vermögenswerte klassifiziert sind, zu ihren beizulegenden Zeitwerten. Der Zeitwert ist der Betrag, für den ein Vermögenswert in einer Transaktion zu Marktbedingungen zwischen sachverständigen, vertragswilligen Parteien getauscht oder eine Verbindlichkeit beglichen werden könnte. Der beizulegende Zeitwert von Finanzinstrumenten basiert auf deren an einer anerkannten Börse notierten offiziellen Marktpreisen oder wird im Fall nicht börsennotierter Instrumente von einem angesehenen Broker/einer angesehenen Gegenpartei bezogen, jeweils zum Bilanzstichtag und ohne Abzug für geschätzte zukünftige Verkaufskosten. Gemäß IFRS 9 werden die Wertpapiere und sonstigen Vermögenswerte der Gesellschaft zum letzten Marktkurs per 31. Dezember 2023 und 2022 bewertet, um das den Inhabern rückzahlbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen („Nettovermögen“) zu bestimmen.

Die Direktoren können jedoch den Wert von finanziellen Vermögenswerten anpassen, wenn sie dies für erforderlich erachten, um deren marktgerechten Wert besser widerzuspiegeln. Ist kein an einer anerkannten Börse notierter offizieller Marktpreis und kein Preis von einem Broker/einer Gegenpartei verfügbar, so wird der wahrscheinliche Realisationswert mit Sorgfalt und in gutem Glauben gemäß der Bewertungspolitik des Fonds berechnet. Dieser wahrscheinliche Realisationswert kann von der Verwaltungsstelle anhand von Bewertungsmethoden ermittelt werden, u. a. unter Zugrundelegung marktüblicher Transaktionen, Bezugnahme auf den aktuellen beizulegenden Zeitwert eines anderen Instruments, das im Wesentlichen gleich ist, Anwendung von Discounted-Cashflow-Analysen, Preisbildungsmodellen für Optionsscheine und jeder anderen Bewertungsmethode, die eine verlässliche Preisschätzung unter Annahme der gegenwärtigen Markttransaktionen ergibt. Weitere Einzelheiten zu den Bewertungsgrundsätzen für alle Wertpapierarten finden Sie im Abschnitt „Beizulegender Zeitwert von Anlagen“ in Anmerkung 12. Anschließend Änderungen im Zeitwert der Kategorie erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert zu bewertende Finanzinstrumente werden in der Gewinn- und Verlustrechnung erfasst.

(iv) Ausbuchung finanzieller Vermögenswerte und Verbindlichkeiten

Der Fonds bucht einen finanziellen Vermögenswert aus, wenn die vertraglichen Ansprüche auf Einnahmen aus dem Vermögenswert erloschen sind oder wenn die Vermögenswerte übertragen werden und diese Übertragung eine Ausbuchung gemäß IFRS 9 begründet. Der Fonds bucht eine finanzielle Verbindlichkeit aus, wenn er von den entsprechenden vertraglichen Verpflichtungen befreit ist bzw. wenn diese erloschen oder abgelaufen sind.

Immobilienaktiengesellschaften

Anteile an Immobilienaktiengesellschaften, die an einem geregelten Markt notiert oder gehandelt werden, werden zum letzten notierten Handelskurs oder Mittelkurs bewertet oder, sofern diese nicht erhältlich oder repräsentativ sind, zum letzten verfügbaren, für den Organismus für gemeinsame Anlagen relevant erscheinenden Nettoinventarwert („NIW“).

Investmentfonds

Der beizulegende Zeitwert einer Anlage, bei der es sich um einen Anteil oder eine Beteiligung an einem Investmentfonds handelt, ist der letzte verfügbare NIW dieses Anteils bzw. dieser Beteiligung.

Mittelfristige Schuldverschreibungen

Bestimmte Portfolios können in direkte Schuldtitel investieren, bei denen es sich um Anteile an Beträgen handelt, die von Unternehmen, staatlichen Stellen oder anderen Kreditnehmern an Kreditgeber oder Kreditsyndikate geschuldet werden. Die Anlagen eines Portfolios in Kredite können in Form von Beteiligungen an Krediten oder Abtretungen aller oder eines Teils der Kredite von Dritten („Bankkredite“) erfolgen. Ein Bankkredit wird häufig von einer Bank oder einem anderen Finanzinstitut (dem „Kreditgeber“) verwaltet, das als Agent für alle Inhaber fungiert. Der Agent verwaltet die Bedingungen des Kredits, wie im Kreditvertrag festgelegt. Bei der Anlage in eine Kreditbeteiligung hat ein Portfolio das Recht, Kapitalzahlungen, Zinsen und etwaige Gebühren, auf die es Anspruch hat, lediglich von dem Kreditgeber zu erhalten, der den Kreditvertrag verkauft, und nur bei Eingang von Zahlungen des Kreditnehmers beim Kreditgeber. Allgemein hat ein Portfolio kein Recht, die Einhaltung der Bedingungen des Kreditvertrags mit dem Kreditnehmer durchzusetzen. Infolgedessen kann ein Portfolio dem Kreditrisiko durch sowohl den Kreditnehmer als auch durch den Kreditgeber, der den Kreditvertrag verkauft, ausgesetzt sein. Wenn ein Portfolio Abtretungen von Kreditgebern erwirbt, erwirbt es direkte Rechte gegenüber dem Kreditnehmer des Kredits.

Das Portfolio kann beim Handel mit Abtretungen und Beteiligungen an Dritte Schwierigkeiten haben. Es kann Beschränkungen für Übertragungen geben und es können nur begrenzte Möglichkeiten bestehen, solche Wertpapiere auf Sekundärmärkten zu verkaufen. Infolgedessen ist das Portfolio möglicherweise nicht in der Lage, Abtretungen oder Beteiligungen zum gewünschten Zeitpunkt zu verkaufen oder muss zu einem Preis unter dem beizulegenden Zeitwert verkaufen.

Das Portfolio kann einen Kreditvertrag über einen bestimmten zugesagten Betrag abschließen, doch wird dieser unter Umständen nicht in voller Höhe vom Kreditnehmer in Anspruch genommen. Diese nicht finanzierten Zusagen stellen die verbleibende Verpflichtung des Portfolios gegenüber dem Kreditnehmer dar. Der Kreditnehmer kann zu jedem Zeitpunkt bis zum Fälligkeitsdatum der Emission den nicht finanzierten Teil einfordern. Der beizulegende Zeitwert dieser ungedeckten Kreditzusagen ist in der Bilanz unter „Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen“ enthalten.

Participatory Notes

Die Portfolios können in Participatory Notes investieren. Participatory Notes, die voll eingezahlt sind und einen Ausübungskurs von null haben, weisen die gleichen Risiko/Rendite-Charakteristika auf, die im Falle eines direkten Kaufs der zugrunde liegenden Aktien vorliegen würden.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR**1. WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE (FORTSETZUNG)****Forderungsbesicherte Wertpapiere und Mortgage-Backed Securities**

Zu den Parametern, die dazu verwendet werden, forderungsbesicherte Wertpapiere und Mortgage-Backed Securities zu bewerten, gehören im Allgemeinen Modelle, die eine Reihe an Faktoren berücksichtigen. Hierzu können folgende Punkte gehören: vorzeitige Rückzahlungen, Cashflows, Spreadanpassungen und andere Marktinformationen wie zum Beispiel Benchmarkrenditen, gemeldete Trades, Broker-Dealer-Quotierungen, Emittentenspreads, Benchmarkwertpapiere, Gebote, Angebote und Referenzdaten wie zum Beispiel falls verfügbar Veröffentlichungen im Bereich der Marktforschung.

TBA-Wertpapiere

Die Portfolios dürfen TBA-Kaufverpflichtungen eingehen, um Wertpapiere zu einem festen Preis und zu einem über den Abrechnungszeitpunkt hinausgehenden Termin zu kaufen. Obwohl der Stückpreis festgelegt worden ist, wurde der Nominalwert noch nicht bestimmt. Bis zum Abrechnungstermin hält und verwaltet das Portfolio in Höhe des Kaufpreises der TBA-Kaufverpflichtung ausreichende Geldmittel oder erstklassige Schuldtitel. Das Portfolio kann auch andere in seinem Besitz befindlichen Wertpapiere für eine Vereinbarung zur Glattstellung der Position verwenden. Erträge aus den Wertpapieren werden erst zum Abrechnungstermin realisiert. Offene TBA-Kaufverpflichtungen wurden mit dem aktuellen Marktwert bewertet.

Die Portfolios dürfen TBA-Verkaufverpflichtungen eingehen, um ihre Portfoliositionen abzusichern oder um hypothekenbesicherte Wertpapiere zu verkaufen, die verzögerten Erfüllungsvereinbarungen (Delayed Delivery) unterliegen. Erlöse aus den TBA-Verkaufverpflichtungen gelten erst zum vertraglichen Abrechnungstermin als realisiert. Solange eine TBA-Verkaufverpflichtung nicht abgerechnet ist, hat das Portfolio ein gleichwertig erfüllbares Wertpapier oder eine glattstellende TBA-Abnahmeverpflichtung, die am oder vor dem Verkaufsverpflichtungstermin zu erfüllen ist, zur „Deckung“ der Verkaufsverpflichtung zu halten. Offene TBA-Kaufverpflichtungen werden gemäß dem in den Bilanzierungsgrundsätzen beschriebenen Verfahren zum aktuellen Marktwert bewertet.

Bedingte Pflichtwandelanleihen

Bedingte Pflichtwandelanleihen (Contingent Convertible Securities, kurz „CoCos“) sind eine Gattung hybrider Wertpapiere, deren Nennwert bei Eintritt bestimmter Auslöser entweder in Eigenkapital umgewandelt oder abgeschrieben wird. Die Auslöser stehen generell in Zusammenhang mit aufsichtsbehördlich vorgegebenen Kapitalquoten oder aufsichtsbehördlichen Maßnahmen, die die weitere Fähigkeit des Emittenten zur Unternehmensfortführung infrage stellen. Die einzigartigen Merkmale von CoCos zur Umwandlung in Eigenkapital oder die Abschreibung sind auf den Emittenten und dessen aufsichtsbehördliche Auflagen zugeschnitten. In aller Regel werden CoCos als nachrangige Schuldtitel begeben, um vor einer Umwandlung die entsprechende Eigenkapitalunterlegung sicherzustellen. Ferner haben CoCos nicht unbedingt eine festgesetzte Laufzeit und können absolut ermessensfreie Kupons aufweisen, die nach Ermessen des Emittenten gestrichen oder von der zuständigen Aufsichtsbehörde untersagt werden können, um dem Emittenten zu ermöglichen, Verluste zu absorbieren.

Devisenterminkontrakte

Ein Devisenterminkontrakt ist eine Vereinbarung zwischen zwei Parteien, eine Währung an einem zukünftigen Datum zu einem festgelegten Preis zu kaufen und zu verkaufen. Der Marktwert eines Devisenterminkontrakts schwankt mit den Devisenterminkursen. Devisenterminkontrakte werden täglich zum Marktwert bewertet, und die Wertveränderung wird vom Portfolio als nicht realisierter Gewinn oder Verlust ausgewiesen. Realisierte Gewinne oder Verluste in Höhe der Differenz zwischen dem Wert des Kontrakts zum Zeitpunkt seines Abschlusses und dem Wert zum Glattstellungszeitpunkt werden nach Lieferung bzw. Entgegennahme der Währung oder, wenn ein Devisenterminkontrakt durch Eingehen eines neuen Devisenterminkontrakts mit demselben Makler glattgestellt wird, nach Abrechnung des Nettogewinns bzw. -verlusts verbucht.

Futures-Kontrakte

Futures-Kontrakte können bestimmte Optionen auf börsengehandelte Futures-Kontrakte enthalten. Anfängliche Einschüsse werden beim Eingehen der Futures-Kontrakte getätigt und erfolgen im Allgemeinen in Barmitteln oder Barmitteläquivalenten. Der beizulegende Zeitwert von Futures-Kontrakten basiert auf ihren täglich notierten Abrechnungspreisen. Veränderungen im Wert offener Futures-Kontrakte werden als nicht realisierte Gewinne oder Verluste aus Futures-Kontrakten bis zur Glattstellung der Kontrakte ausgewiesen, danach erfolgt der Ausweis realisierter Gewinne und Verluste. Gewinne bzw. Verluste aus offenen Futures-Kontrakten werden in der Aufstellung des Wertpapierbestands des jeweiligen Portfolios aufgeführt und in der Bilanz jeweils unter den erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten bzw. Verbindlichkeiten ausgewiesen.

Swap-Kontrakte

Ein Swap-Kontrakt ist eine außerbörsliche Vereinbarung zwischen einem Portfolio und einer Gegenpartei, die Rendite eines Instruments gegen die Rendite eines anderen Instruments zu tauschen. Manche Swap-Kontrakte werden netto abgewickelt. Beim Eingehen eines Swap-Kontrakts im Freiverkehr („OTC-Kontrakt“) und während der Laufzeit der Transaktion kann das Portfolio und/oder der Swap-Kontrahent gemäß den Bestimmungen der jeweiligen Swap-Vereinbarungen Bargeld oder Wertpapiere als Sicherheiten stellen bzw. entgegennehmen, damit für den Fall eines Zahlungsausfalls oder eines Konkurses/einer Insolvenz werthaltige Vermögenswerte und Rückgriffsmöglichkeiten bereitstehen. Einige Clearingstellen bieten die Abwicklung von eingeschränkten Arten von Swaps. Bei einer abgewickelten Swap-Transaktion geht ein Portfolio die Transaktion in der Regel mit einem Finanzinstitut als Gegenpartei ein, die dann durch eine zentrale Clearingstelle abgewickelt wird. Nach Annahme eines Swaps durch eine zentrale Clearingstelle erlischt der Swap und wird durch einen Swap mit der Clearingstelle ersetzt, dadurch wird das Kreditrisiko des Portfolios gegenüber der ursprünglichen Gegenpartei reduziert oder eliminiert.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR**1. WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE (FORTSETZUNG)****Swap-Kontrakte (Fortsetzung)**

Ein Portfolio muss in der Regel eine bestimmte Höhe einer Einschuss- und Nachschussmarge bei der Clearingstelle oder nach Weisung der Clearingstelle hinterlegen. Die tägliche Veränderung in der Bewertung wird als Forderung oder Verbindlichkeit für Nachschusszahlungen verbucht und in bar mit der zentralen Clearing-Partei abgewickelt.

Zins-/Inflation-Swaps

Ein Portfolio kann Zins- oder Inflation-Swaps eingehen. Dabei handelt es sich um Vereinbarungen zwischen zwei Parteien über den Austausch von Zahlungsströmen auf Basis eines fiktiven Kapitalbetrags, mit denen das Zinsrisiko eines Portfolios gesteuert wird. Sowohl bei Zinsswaps als auch bei Inflation-Swaps verpflichtet sich eine Partei, der Swap-Gegenpartei eine festverzinsliche Zahlung zu leisten, während die andere Partei dem Portfolio eine variabel verzinsliche Zahlung leistet. Zinsswap- und Inflation-Swapkontrakte werden täglich zum Marktwert bewertet, in manchen Fällen auf Basis von Notierungen von Kontrahenten und in anderen Fällen auf Basis von Notierungen von Kursanbietern. Die Wertveränderung wird als nicht realisierter Gewinn bzw. Verlust verbucht. Geleistete und vereinnahmte Zahlungen werden als realisierte Gewinne bzw. Verluste ausgewiesen. Einige Zinsswaps können als Forward Starting Swaps betrachtet werden. Abgrenzungen auf Forward Starting Swaps beginnen zu einem zukünftigen Zeitpunkt.

Credit Default Swaps

Ein Credit Default Swap ist ein bilateraler Finanzkontrakt, bei dem der Absicherungskäufer eine Gebühr zahlt (in der Regel ausgedrückt in Basispunkten p. a. auf den Nennbetrag) und vom Absicherungsverkäufer im Gegenzug dafür eine Zahlung erhält, wenn in Bezug auf einen Referenzemittenten ein bestimmtes Kreditereignis eintritt, wie z. B. ein Konkurs, ein Zahlungsausfall oder eine Restrukturierung. Die Kreditereignisse und Abwicklungsmechanismen, die angewandt werden, um die Ausfallzahlung zu bestimmen, werden zwischen den Kontrahenten zum Zeitpunkt des Vertragsabschlusses ausgehandelt.

Sobald der Eintritt des Kreditereignisses erklärt wird, ist der Absicherungskäufer berechtigt, den Kontrakt abzuwickeln. Die Abwicklung erfolgt in der Regel physisch, wobei der Absicherungskäufer das Recht hat, Anleihen des Referenzemittenten bis zur Höhe des Nominalwertes des Kontrakts zu liefern. Im Gegenzug erhält der Absicherungskäufer den Nennwert dieser Schuldtitel. Absicherungsverkäufe sind das synthetische Äquivalent eines Kaufs einer Anleihe oder anderen Art von Schuldtitel. Absicherungskäufe sind das Äquivalent eines synthetischen Leerverkaufs oder der Absicherung einer Anleihe oder eines anderen Kreditengagements. Bei Credit Default Swaps auf Kreditindizes leistet eine Partei einen Zahlungsstrom zugunsten einer anderen Partei und erwirbt dafür einen Anspruch auf einen bestimmten Ertrag im Falle einer Abschreibung, einer Minderung des Grundkapitals, einer Minderung der Zinsen oder des Zahlungsausfalls aller oder eines Teils der Referenzemittenten, aus denen der Kreditindex besteht. Ein Kreditindex ist eine Auswahl aus einem Korb von Kreditinstrumenten oder Engagements, die als repräsentativ für einen Teil des gesamten Kreditmarktes angesehen wird. Der Index kann unter anderem aus folgenden Komponenten bestehen: Wertpapiere mit Investment-Grade-Rating, hochverzinsliche Wertpapiere, ABS-Anleihen, Schwellenmarktpapiere und/oder verschiedenen Bonitätsratings innerhalb jedes Sektors. Kreditindizes werden gehandelt, indem Credit Default Swaps mit standardisierten Bedingungen, wie z. B. einem festen Spread und standardisierten Fälligkeitsdaten eingesetzt werden. Ein Credit Default Swap auf einen Index bezieht sich auf alle Indexkomponenten, und bei Eintritt eines Zahlungsausfalls wird das Kreditereignis basierend auf der Gewichtung der Indexkomponente beglichen. Die Zusammensetzung der Indizes ändert sich regelmäßig, in der Regel alle sechs Monate, und in den meisten Indizes sind alle Komponenten gleich gewichtet.

Der Einsatz von Credit Default Swaps ist insoweit beschränkt, dass der Nutzen für das Portfolio dem Nutzen entsprechen muss, der durch ein direktes Investment in den Basisinstrumenten erzielt werden könnte, und dass die Swaps ein Portfolio keinen Risiken aussetzen dürfen, die es ansonsten nicht eingehen würde (außer dem Risiko in Bezug auf den Kontrahenten des Credit Default Swap). Die bei Abschluss bei einem Portfolio als Absicherungsverkäufer eingehende Zahlung wird in den Büchern des Portfolios als Verbindlichkeit ausgewiesen. Eine bei Abschluss von einem Portfolio als Absicherungskäufer geleistete Zahlung wird in den Büchern des Portfolios als Vermögenswert ausgewiesen. Bei einem Portfolio eingehende oder von diesem geleistete Zahlungen werden als realisierte Gewinne bzw. Verluste ausgewiesen. Credit Default Swaps werden mit Hilfe eines Pricing-Service-Anbieters bewertet. Ist kein Pricing-Service-Anbieter verfügbar, können Kontrakte täglich zum Marktpreis bewertet werden. Dabei beruht die Bewertung auf Kursnotierungen von Kontrahenten oder auf Berechnungen unter Verwendung von Bewertungsmodellen. Eine etwaige Wertveränderung wird als nicht realisierter Gewinn oder Verlust verbucht. Zahlungen, die infolge eines Kreditereignisses oder der Beendigung des Vertrages eingehen bzw. geleistet werden, werden nach Abzug eines anteiligen Betrags der Vorauszahlung als realisierte Gewinne oder Verluste verbucht.

Total Return Swaps

Total Return Swaps beinhalten die Verpflichtung zur Zahlung eines festen oder variablen Zinssatzes im Gegenzug für eine marktabhängige Rendite auf Basis eines Nominalwerts. Das Portfolio erhält eine Zahlung oder leistet eine Zahlung an die Gegenpartei in dem Maße, in dem die Gesamrendite des Referenztitels oder -index, der dem Total Return Swap zugrunde liegt, die gegenläufige Zinsverpflichtung über- oder unterschreitet. Der Abschluss von Total Return Swaps kann mit bestimmten Risiken verbunden sein, darunter der Ausfall der Gegenpartei, Illiquidität oder ungünstige Veränderungen des Werts des zugrunde liegenden Referenztitels oder -index. Der Barausgleich in und aus den Swaps kann nach dem Ermessen des Portfoliomanagements und der Gegenpartei während der Laufzeit der Vereinbarung zu einem Reset- oder einem anderen Datum erfolgen und wird im Allgemeinen auf der Grundlage von Grenz- und Schwellenwerten bestimmt, die im Rahmen einer zwischen dem Portfoliomanagement und der Gegenpartei getroffenen Vereinbarung festgelegt werden. Bei Basket-Swaps können die Cashflows, je nach Lokalwährung der Positionen innerhalb der Swaps, auf verschiedene Fremdwährungen lauten.

Etwaige Bewertungsveränderungen werden als nicht realisierte Gewinne bzw. Verluste ausgewiesen. Geleistete und vereinnahmte Zahlungen werden als realisierte Gewinne bzw. Verluste ausgewiesen. Der Fonds legt ausstehende Total Return Swaps am Jahresende in der Aufstellung des Wertpapierbestands offen. Für die am 31. Dezember 2023 und am 31. Dezember 2022 beendeten Geschäftsjahre ist der beizulegende Zeitwert der Total Return Swaps in der Aufstellung des Wertpapierbestands und in der Bilanz als nicht realisierter Nettogewinn oder -verlust ausgewiesen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR**1. WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE (FORTSETZUNG)****Swap-Kontrakte (Fortsetzung)***Volatility-Swaps*

Ein Volatility-Swap ist eine Vereinbarung zwischen Gegenparteien über den Austausch regelmäßiger Zahlungen auf Basis der festgestellten Volatilität eines Referenztitels, eines Referenzindex, einer Referenzwährung oder einer anderen Referenzanlage über einen festgelegten Zeitraum. Einer der Cashflows basiert in der Regel auf der realisierten Volatilität der Referenzanlage, festgestellt anhand von Änderungen des Preises oder Kursniveaus dieser Anlage über den festgelegten Zeitraum, während der andere Cashflow auf einem spezifischen Satz basiert, der die zum Zeitpunkt der Ausführung des Swaps erwartete Volatilität der Referenzanlage oder die festgestellte Volatilität einer anderen Referenzanlage über den festgelegten Zeitraum repräsentiert. Der Wertzuwachs oder die Wertminderung eines Volatility-Swap ist in der Regel auf das Ausmaß der Volatilität der Referenzanlage bzw. den Umfang seiner Kursschwankungen während des festgelegten Zeitraums zurückzuführen und nicht auf allgemeine direktionale Kursbewegungen.

Volatility-Swaps sind ihrer Struktur nach weniger standardisiert als andere Arten von Swaps und bieten ein reines bzw. isoliertes Engagement bezogen auf das Volatilitätsrisiko der jeweils zugrunde liegenden Referenzanlage. Für gewöhnlich werden Volatility-Swaps eingesetzt, um auf künftige Schwankungsbreiten zu spekulieren, Transaktionen in Bezug auf den Spread zwischen realisierter und erwarteter Volatilität einzugehen oder das Volatilitätsrisiko der vom Portfolio gehaltenen Anlagen zu mindern.

Variance-Swaps

Variance-Swap-Kontrakte erstrecken sich auf eine Vereinbarung zwischen zwei Parteien über den Austausch von Zahlungsströmen auf Basis der gemessenen Varianz (d. h. des Quadrats der Volatilität) eines bestimmten Basiswerts. Eine Partei erklärt sich im Rahmen dieser Vereinbarung bereit, einen „festen Zinssatz“ oder eine Zahlung in Bezug auf den Ausübungspreis gegen einen „variablen Zinssatz“ oder eine realisierte Preisvarianz des Basiswerts in Bezug auf den Nominalwert zu tauschen. Bei Vertragsabschluss wird der Ausübungspreis in der Regel so festgelegt, dass der beizulegende Zeitwert des Swaps gleich Null ist. Folglich findet bei Vertragsbeginn keinerlei Zahlungsaustausch statt. Am Fälligkeitstag entspricht der von einer Partei an die andere zu zahlende Betrag der Differenz zwischen der realisierten Preisvarianz des Basiswerts und dem Ausübungspreis, multipliziert mit dem Nominalwert. Ein Empfänger der realisierten Preisvarianz hätte Anspruch auf eine Zahlung, wenn die realisierte Preisvarianz des Basiswerts über dem Ausübungspreis liegt, und wäre zu einer Zahlung verpflichtet, wenn die Preisvarianz unter dem Ausübungspreis liegt. Ein Zahler der realisierten Preisvarianz wäre zu einer Zahlung verpflichtet, wenn die realisierte Preisvarianz des Basiswerts über dem Ausübungspreis liegt, und hätte Anspruch auf eine Zahlung, wenn die Preisvarianz unter dem Ausübungspreis liegt. Bei dieser Art von Vereinbarung handelt es sich im Grunde genommen um einen Terminkontrakt auf die künftige realisierte Preisvarianz des Basiswerts.

Correlation-Swaps

Ein Correlation-Swap ist ein Kontrakt, bei dem der Optionskäufer die Differenz zwischen der beobachteten Korrelation und der Korrelation zum Ausübungszeitpunkt eines Korbs von Vermögenswerten erhält, dessen Entwicklung über einen bestimmten Zeitraum beobachtet wird. Der Correlation-Swap kann als Terminkontrakt auf die realisierte Korrelation gesehen werden. Sein Auszahlungsprofil besteht einfach in der Differenz zwischen der realisierten Korrelation über den angegebenen Zeitraum und der Korrelation zum Ausübungszeitpunkt, multipliziert mit dem Nominalwert des Kontrakts. Aufgrund der Beschaffenheit des Kontrakts ist die Auszahlung mit dem Näherrücken der Fälligkeit de facto bekannt, da alle Beobachtungen für die Berechnung der Korrelation de facto bekannt sind. Daher nimmt das Modellrisiko mit zunehmender Laufzeit des Vertrags ab. Bei einem ausstehenden Kontrakt muss die implizite Korrelation für alle zukünftigen Korrelationen berechnet werden, die als Marktpreis der zukünftigen Korrelation gesehen werden können. Die implizite Korrelation bzw. Korrelationsmarke lässt sich aus beobachteten Preisen für Correlation-Swaps oder aus Notierungen von OTC-Händlern ableiten.

Optionen

Optionskontrakte können bestimmte Optionen auf börsengehandelte Futures-Kontrakte enthalten. Schreibt ein Portfolio eine Option, wird der Betrag, der dem Portfolio erhaltenen Prämie entspricht, als Verbindlichkeit verbucht und anschließend der beizulegende Zeitwert der geschriebenen Option um diesen Betrag angepasst. Die Prämie auf ausgeübte geschriebene Kaufoptionen wird bei der Ermittlung des realisierten Gesamtgewinns oder -verlusts zu den Erlösen aus dem Verkauf des zugrundeliegenden Wertpapiers oder der Fremdwährung hinzugerechnet. Die Prämie auf ausgeübte verkaufte Verkaufsoptionen wird von den Kosten für die erworbenen Wertpapiere, Indizes, Derivate oder Fremdwährungen abgezogen. Prämien aus geschriebenen Optionen, die verfallen, werden als realisierte Gewinne behandelt. Die Prämie auf gekaufte und ausgeübte Verkaufsoptionen wird bei Ermittlung des realisierten Gewinns oder Verlustes vom Verkaufserlös des Basiswerts bzw. der Basiswährung abgezogen. Die Prämie auf ausgeübte gekaufte Kaufoptionen wird zu den Kosten des gekauften Wertpapiers, Index, Derivats bzw. der gekauften Währung addiert. Auf den Kauf von auslaufenden und nicht ausgeübten Optionen gezahlte Prämien werden als realisierte Verluste behandelt. Die Ausübungspreise für Optionen auf Aktienkörbe lauten auf verschiedene Fremdwährungen, je nach den Landeswährungen der Positionen in den Wertpapierkörben.

Swaptions

Schreibt ein Portfolio eine Swaption, wird ein der Prämie, die der Portfolio erhält, entsprechender Betrag als Verbindlichkeit verbucht und anschließend auf den beizulegenden Zeitwert der geschriebenen Swaption angepasst. Erhaltene Prämien aus geschriebenen Swaptions, die unausgeübt verfallen, werden vom Portfolio an den Verfallsdaten als realisierte Gewinne behandelt. Die Prämie auf ausgeübte geschriebene Payer-Swaptions wird bei der Ermittlung des realisierten Gewinns oder Verlusts zu den Erlösen aus dem Verkauf des zugrundeliegenden Swaps hinzugerechnet. Wird eine geschriebene Receiver-Swaption ausgeübt, reduziert die Prämie die Kostenbasis des gekauften Swaps.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

1. WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE (FORTSETZUNG)

Optionen (Fortsetzung)

Swaptions (Fortsetzung)

Kauft ein Portfolio eine Swaption, wird ein der Prämie, die der Portfolio gezahlt hat, entsprechender Betrag als Vermögenswert verbucht und anschließend auf den beizulegenden Zeitwert der gekauften Swaption angepasst. Auf den Kauf von auslaufenden und nicht ausgeübten Swaptions gezahlte Prämien werden am Verfallsdatum als realisierte Verluste behandelt. Die Prämie auf ausgeübte gekaufte Payer-Swaptions wird bei der Feststellung, ob das betreffende Portfolio einen realisierten Gewinn oder Verlust hat, von den Erlösen des zugrundeliegenden Swaps abgezogen. Die Prämie auf ausgeübte Receiver-Swaptions wird zu der Kostenbasis der getauschten variabel verzinslichen Anlage addiert.

Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Das Portfolio kann umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließen, in deren Rahmen es von einem Verkäufer Wertpapiere erwirbt (zum Beispiel eine Bank oder ein Wertpapierhändler), der zum Zeitpunkt des Verkaufs zustimmt, das Wertpapier zu einem gemeinsam festgelegten Datum und Preis zurückzukaufen und somit die Rendite für das Portfolio während der Laufzeit des umgekehrten Pensionsgeschäft festlegt. Der Rückkaufpreis ist der Kaufpreis plus ein vereinbarter Marktzins, der nicht im Zusammenhang mit dem Zinssatz oder der Fälligkeit des gekauften Wertpapiers steht. Das Portfolio kann auch umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließen, in deren Rahmen es ein Wertpapier verkauft und zustimmte, es zu einem gemeinsam festgelegten Datum und Preis zurückzukaufen.

Differenzkontrakte

Differenzkontrakte werden zur Schlussnotierung des zugrundeliegenden Wertpapiers abzüglich der jedem Kontrakt zurechenbaren Finanzierungskosten (die separat verbucht werden), umgerechnet in die Basiswährung des Differenzkontrakts, bewertet. Der aktuelle Marktwert wird in der Bilanz ausgewiesen. Beim Eingehen von Differenzkontrakten kann ein Portfolio verpflichtet sein, dem Broker einen Geldbetrag und/oder andere Vermögenswerte in Höhe eines bestimmten Prozentsatzes des Kontraktwertes („Ersteinschuss“) als Sicherheit zu übertragen. Anschließend werden je nach den Wertschwankungen des zugrundeliegenden Wertpapiers regelmäßig so genannte „Nachschusszahlungen“ vom einem Portfolio geleistet bzw. entgegengenommen. Während der Laufzeit des Differenzkontrakts werden Wertänderungen des Kontrakts als nicht realisierte Gewinne bzw. Verluste anhand der Marktbewertungsmethode an jedem Bewertungstag erfasst, so dass der Wert des zugrundeliegenden Wertpapiers widerspiegelt wird. Bei Schließung des Kontrakts entsprechen die realisierten Gewinne oder Verluste der Differenz zwischen dem Wert des Kontrakts zum Zeitpunkt seiner Eröffnung (einschließlich der Finanzierungskosten) und dem Wert zum Zeitpunkt seiner Schließung. Die Differenzkontrakten zuzurechnenden Dividenden (nach Abzug von Quellensteuern) werden als Dividendenforderungen oder -verbindlichkeiten am Ende des Geschäftsjahres verbucht.

Saldierung von Finanzinstrumenten

Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten werden nur dann saldiert und der Nettobetrag in der Bilanz ausgewiesen, wenn ein Rechtsanspruch besteht, die erfassten Beträge miteinander zu verrechnen und beabsichtigt wird, entweder den Ausgleich auf Nettobasis herbeizuführen oder gleichzeitig mit der Verwertung der betreffenden Vermögenswerte die dazugehörigen Verbindlichkeiten abzulösen.

Barmittel und Barmitteläquivalente

Barmittel umfassen Sichtguthaben bei Banken. Barmitteläquivalente sind kurzfristige hochliquide Investitionen, die jederzeit in festgelegte Zahlungsmittelbeträge umgewandelt werden können, nur einem unwesentlichen Wertschwankungsrisiko unterliegen und zur Begleichung kurzfristiger Barverpflichtungen und nicht für Anlagezwecke oder andere Zwecke gehalten werden. Barmittel und Barmitteläquivalente werden zu ihrem Nennwert, gegebenenfalls einschließlich aufgelaufener Zinsen, am Bewertungszeitpunkt des jeweiligen Handelstages bewertet, es sei denn, nach Einschätzung der Direktoren (in Konsultation mit dem Manager und der Verwaltungsstelle) muss eine Anpassung vorgenommen werden, damit ihr tatsächlicher Wert reflektiert wird.

Kassenbestände des Fonds

Einige der Kassenbestände des Fonds werden gemäß den Leitlinien der Central Bank of Ireland mit dem Titel „Umbrella Funds – Cash Accounts Holding Subscription, Redemption and Dividend Monies“ (Kassenbestände mit Zeichnungs- Rücknahme- und Ausschüttungsgeldern) von der Verwaltungsstelle im Auftrag des Fonds gehalten. Diese Kassenbestände werden bei Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited (die „Verwahrstelle“) für den Fonds in Konten für nicht bearbeitete Zeichnungsgelder von Anlegern, an Anleger zahlbare Rücknamegelder und/oder sonstige an Anleger zahlbare Beträge gehalten und gelten als Vermögenswerte des Fonds. Jegliche zum Ende des Geschäftsjahres auf diesen Barkonten gehaltenen Gelder werden in den Gesamtbilanzen des Fonds ausgewiesen.

Forderungen von/gegenüber Brokern

Die von den Portfolios an eine Gegenpartei im Zusammenhang mit derivativen Finanzinstrumenten geleistete Marge und Sicherheiten werden in der Bilanz als Forderungen gegenüber Brokern ausgewiesen. Die von der Gegenpartei an ein Portfolio im Zusammenhang mit derivativen Finanzinstrumenten geleistete Marge und Sicherheiten werden in der Bilanz als Verbindlichkeiten gegenüber Brokern ausgewiesen. Bareinschüsse werden zum beizulegenden Zeitwert bewertet.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR**1. WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE (FORTSETZUNG)****Währungsumrechnung***Funktionale Währung und Darstellungswährung*

Die funktionale und die Darstellungswährung Corporate Hybrid Bond, des Euro Bond Absolute Return, des Euro Bond, des European High Yield Bond, des European Sustainable Equity, des Macro Opportunities FX und des Ultra Short Term Euro Bond ist der Euro. Die funktionale Währung und die Darstellungswährung des China A-Share Equity und des China Bond ist der CNY. Die funktionale Währung und die Darstellungswährung des Japan Equity Engagement ist der JPY. Die funktionale Währung und die Darstellungswährung aller anderen Portfolios ist der US-Dollar. Da die Basiswährung des größten Teils des Nettovermögens des Fonds der US-Dollar ist, wird der US-Dollar als die am besten geeignete Konsolidierungswährung betrachtet. Weitere Einzelheiten hierzu sind in Anmerkung 15 enthalten

Transaktionen und Salden

Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die auf andere Währungen als die funktionale Währung des Portfolios lauten, werden zu dem am Bilanzstichtag geltenden Wechselkurs in die funktionale Währung umgerechnet. Transaktionen in anderen Währungen als der funktionalen Währung des Portfolios werden zu dem am Datum der jeweiligen Transaktion geltenden Wechselkurs in die funktionale Währung umgerechnet. Gewinne und Verluste aus Devisentransaktionen werden bei der Ermittlung des Jahresergebnisses in der Gewinn- und Verlustrechnung ausgewiesen.

Zeichnungsgelder und Beträge, die bei der Rücknahme rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile in anderen Währungen als der funktionalen Währung gezahlt werden, werden zu dem am Datum der jeweiligen Transaktionen geltenden Wechselkurs in die funktionale Währung umgerechnet. Die Bilanz wird anhand der Wechselkurse zum Jahresende umgerechnet, und die Gewinn- und Verlustrechnung sowie die Aufstellung über die Entwicklung des Nettovermögens werden zum Durchschnittskurs des Jahres umgerechnet.

Verbuchung von Aufwand und Ertrag

Dividendenerträge werden in der Gewinn- und Verlustrechnung an dem Datum verbucht, an dem das betreffende Wertpapier „ex-Dividende“ notiert ist, soweit die entsprechende Information dem Portfolio in angemessener Weise zur Verfügung steht. Dividenden und Zinserträge werden vor Abzug von Quellensteuern ausgewiesen, die nicht zurückgefordert werden können und gesondert in der Gewinn- und Verlustrechnung ausgewiesen werden, sowie nach Abzug von etwaigen Steuergutschriften. Zinsen aus Bankeinlagen werden auf Kassenbasis verbucht, während andere Erträge periodengerecht ausgewiesen werden.

Zinserträge werden in der Gewinn- und Verlustrechnung für alle Schuldinstrumente, die als erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte klassifiziert sind, periodengerecht ausgewiesen.

Realisierte Gewinne und Verluste aus Anlagen

Realisierte Gewinne und Verluste aus der Veräußerung von finanziellen Vermögenswerten, die erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet werden, werden auf einer „First in/First out“-Basis berechnet. Die damit verbundene Wechselkursbewegung zwischen dem Kauf- und dem Verkaufsdatum bei Veräußerung von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten wird in den Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten einbezogen. Anlagetransaktionen werden am Handelstag verbucht, d. h. dem Tag, an dem das Portfolio sich verpflichtet, den entsprechenden Vermögenswert zu kaufen oder zu verkaufen.

Besteuerung

Gemäß geltendem Recht und den branchenüblichen Usancen ist der Fonds als Investmentgesellschaft im Sinne von Section 739B(1) des Taxes Consolidation Act von 1997 (Gesetz zur Steuerkonsolidierung), in seiner aktuellen Fassung, anerkannt. Dementsprechend sind seine relevanten Erträge oder Kapitalgewinne in Irland nicht steuerpflichtig. Jedoch können dem Fonds beim Eintreten eines Steuertatbestands irische Steuern entstehen.

Ein Steuertatbestand umfasst Ausschüttungszahlungen an Anteilinhaber oder die Einlösung, Rücknahme oder Übertragung von Anteilen sowie das Halten von Anteilen am Ende eines jeden Achtjahreszeitraums, beginnend mit dem Erwerb der Anteile. Bei Steuertatbeständen werden für den Fonds keine irischen Steuern fällig bei:

- (i) einem Anteilinhaber, der weder irischer Staatsbürger ist noch im Sinne des Steuerrechts zum Zeitpunkt des Steuertatbestands als in Irland ansässig gilt, vorausgesetzt, er hat die entsprechenden gültigen Erklärungen gemäß den Richtlinien des Taxes Consolidation Act von 1997 in der jeweils gültigen Fassung beim Fonds eingereicht, und
- (ii) bestimmte steuerbefreite, in Irland ansässige Anteilinhaber, die beim Fonds die notwendigen unterzeichneten Erklärungen eingereicht haben.

In diesem Berichtszeitraum lagen keine Steuertatbestände vor.

Etwaige Veräußerungsgewinne, Dividenden und Zinsen, welche der Fonds durch seine Wertpapiere erzielt, können ggf. Quellensteuern der Länder unterliegen, aus denen diese Erträge/Gewinne erzielt werden, und diese Steuern können vom Fonds oder seinen Anteilhabern ggf. nicht wiedererlangt werden.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

1. WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE (FORTSETZUNG)

Besteuerung (Fortsetzung)

Der Finance Act von 2010 sieht vor, dass die Steuerbehörden Investmentfonds, die außerhalb Irlands vermarktet werden, die Genehmigung erteilen können, Zahlungen an nicht in Irland ansässige Anleger ohne Abzug der irischen Steuer zu leisten, wenn keine maßgebliche Erklärung vorliegt, sofern „äquivalente Maßnahmen“ getroffen werden. Ein Fonds, der diese Genehmigung erhalten will, muss diese schriftlich bei den Steuerbehörden beantragen und die Erfüllung der maßgeblichen Bedingungen bestätigen. Die Gesellschaft hatte zum 31. Dezember 2023 und 2022 keinen Antrag auf Genehmigung bei der Revenue Commission gestellt.

Die Gesellschaft hat die Steuerposition für die offenen Steuerjahre zum 31. Dezember 2023 und 2022 überprüft und entschieden, dass keine Rückstellung für Ertragssteuern und/oder ungewisse Steuerpositionen im Abschluss der Gesellschaft erforderlich ist.

Es bestehen Unsicherheiten hinsichtlich der Auslegung komplexer Steuervorschriften und steuerrechtlicher Änderungen in Bezug auf ausländische Quellensteuern. Angesichts des breiten Spektrums an internationalen Anlagen könnten Differenzen, die sich zwischen tatsächlichen Investmenterträgen und den getroffenen Annahmen ergeben, oder künftige Änderungen an derartigen Annahmen weitere Berichtigungen des bereits erfassten Steueraufwands erfordern.

Der Fonds bildet auf der Grundlage angemessener Schätzungen Rückstellungen für die potenziellen Folgen von Prüfungen durch die Steuerbehörden der jeweiligen Länder, in denen er investiert. Die Höhe derartiger Rückstellungen richtet sich nach verschiedenen Faktoren wie Erfahrungen aus früheren Steuerprüfungen und abweichenden Auslegungen der Steuervorschriften durch das steuerpflichtige Unternehmen und die zuständige Steuerbehörde. Derartige unterschiedliche Auslegungen können sich zu vielen verschiedenen Fragen ergeben, je nach der vorliegenden Situation im Domizilland der jeweiligen Anlage. Da der Fonds die Wahrscheinlichkeit von Rechtsstreitigkeiten und anschließenden Abflüssen von Zahlungsmitteln im Hinblick auf Steuern als gering erachtet, wurde in den Geschäftsjahren zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 keine Eventualverbindlichkeit ausgewiesen.

Rückzahlbare, gewinnberechtigende Anteile

Die rückzahlbaren, gewinnberechtigenden Anteile sind auf Wunsch der Anteilinhaber zurückzunehmen und werden als finanzielle Verbindlichkeiten eingestuft. Ausschüttungen auf diese Anteile werden in der Gewinn- und Verlustrechnung unter Finanzierungskosten ausgewiesen. Die rückzahlbaren, gewinnberechtigenden Anteile können an jedem Handelstag gegen einen Barbetrag an das Portfolio zurückgegeben werden, der ihrem anteiligen Wert am NIW des Portfolios entspricht. Die rückzahlbaren, gewinnberechtigenden Anteile werden zu dem Rücknahmebetrag ausgewiesen, der zum Bilanzstichtag zahlbar wäre, wenn der Anteilinhaber von seinem Recht auf Rückgabe des Anteils an das Portfolio Gebrauch gemacht hätte.

Ausschüttungspolitik

Die Direktoren haben beschlossen, sämtliche Nettoerträge und realisierten Nettokapitalgewinne, die den thesaurierenden Klassen zuzurechnen sind, wiederanzulegen, und sie beabsichtigen daher nicht, für Anteile dieser Klassen Dividenden festzusetzen.

Quelle der Ausschüttungen

Satzungsgemäß können die Direktoren Dividenden auf Anteile aus den Nettoerträgen (einschließlich Dividendenerträge und Zinserträge) und/oder dem Überschuss aus realisierten und nicht realisierten Gewinnen nach Abzug der realisierten und nicht realisierten Verluste aus den Anlagen des Fonds (gemeinsam „Nettoertrag“) und auch aus dem Kapital beschließen. Dividenden, die aus dem Kapital gezahlt werden, kommen einer Rückzahlung oder Entnahme eines Teils der ursprünglichen Anlage eines Anteilinhabers oder aus Kapitalerträgen, die dieser ursprünglichen Anlage zuzurechnen sind, gleich. Solche Dividenden können unmittelbar zu einem Rückgang des NIW der betreffenden Anteile führen.

Die Direktoren beabsichtigen derzeit, vorbehaltlich einer „de-minimis“-Grenze, mindestens 85 % der Nettoerträge, die jeder ausschüttenden Klasse zurechenbar sind, als Dividende festzusetzen und auszuschütten; ausgenommen sind hiervon (i) die (wöchentlich) ausschüttenden Klassen, (ii) die (monatlich) ausschüttenden Klassen, (iii) die (CG) ausschüttenden Klassen und (iv) alle sonstigen ausschüttenden Klassen in einem Portfolio, die laut dem maßgeblichen Prospektzusatz Dividenden aus Kapital und Nettoertrag ausschütten. Die Anteilinhaber sollten jedoch beachten, dass die Direktoren sich in Bezug auf eine ausschüttende Klasse in ihrem eigenen Ermessen für oder gegen eine solche Festsetzung und Ausschüttung entscheiden können.

Im Bezug auf die monatlich ausschüttenden Klassen, die wöchentlich ausschüttenden Klassen und die (CG) ausschüttenden Klassen beabsichtigen die Direktoren, eine den Anteilen dieser Klassen zuweisbare, (wie zutreffend) monatliche, wöchentliche oder halbjährliche Dividende festzusetzen und zu zahlen; dies geschieht durch eine Kombination aus Nettoertrag und Kapital, so dass, falls der Nettoertrag für den entsprechenden Zeitraum weniger als der festgesetzte Betrag ist, die Differenz aus dem die betreffenden Anteile repräsentierenden Kapital gezahlt wird, was es den Klassen ermöglicht, regelmäßige, feste Dividenden auszuschütten. Falls die Nettoeinkünfte, die den (wöchentlich) ausschüttenden Klassen, den (monatlich) ausschüttenden Klassen oder den (CG) ausschüttenden Klassen zuzuschreiben sind, den Betrag übersteigen, der während des entsprechenden Zeitraums erklärt wurde, wird der Betrag der Nettoeinkünfte, der diesen Betrag übersteigt, in einem Ausschüttungskonto für die jeweiligen Anteile gehalten und bildet Teil der Dividende, die für spätere Ausschüttungszeiträume zu zahlen ist. Vorstehendes gibt die derzeitige Absicht der Direktoren bezüglich der Festsetzung und Zahlung von Dividenden für die (monatlich) ausschüttenden Klassen und die (wöchentlich) ausschüttenden Klassen wieder. Die Direktoren können sich jedoch in ihrem eigenen Ermessen gegen eine solche Festsetzung und Zahlung entscheiden, und es gibt keine Garantie dafür, dass solche Dividenden gezahlt werden.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR**1. WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE (FORTSETZUNG)****Ausschüttungspolitik (Fortsetzung)***Ausschüttungshäufigkeit*

Unter normalen Umständen beabsichtigen die Direktoren, die Dividenden wie folgt zu zahlen:

- (a) Bei allen (wöchentlich) ausschüttenden Klassen in allen Portfolios werden Dividenden am oder vor dem letzten Geschäftstag einer jeden Woche erklärt und gezahlt;
- (b) Bei allen (monatlich) ausschüttenden Klassen in allen Portfolios werden Dividenden am oder vor dem letzten Geschäftstag eines jeden Monats festgesetzt und drei Geschäftstage später gezahlt;
- (c) bei allen (CG) ausschüttenden Klassen aller Portfolios ist beabsichtigt, dass etwaige Dividenden auf halbjährlicher Basis festgesetzt und innerhalb von dreißig Geschäftstagen gezahlt werden;
- (d) bei allen anderen ausschüttenden Klassen des China Bond, des Euro Bond, des Euro Bond Absolute Return, des Global Equity Megatrends und des Ultra Short Term Euro Bond werden Dividenden vierteljährlich erklärt und innerhalb von dreißig Geschäftstagen in Bezug auf den Nettoertrag der ausschüttenden Klassen für das vorhergehende Quartal gezahlt;
- (e) bei jeder der ausschüttenden Klassen des Climate Innovation, des CLO Income, des Commodities, des Corporate Hybrid Bond, des Developed Market FMP – 2027, des Emerging Market Debt - Hard Currency, des Emerging Market Debt - Local Currency, des Emerging Market Debt Blend, des Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend, des European High Yield Bond, des Event Driven, des Global Bond, des Global Diversified Income FMP – 2024, des Global Flexible Credit Income, des Global High Yield SDG Engagement, des Global Investment Grade Credit, des Global Opportunistic Bond, des Global Real Estate Securities, des High Yield Bond, des Short Duration Emerging Market Debt, des Short Duration High Yield SDG Engagement, des Strategic Income, des Sustainable Asia High Yield, des Sustainable Emerging Market Corporate Debt, des Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency, des Tactical Macro, des US Equity Index PutWrite und des US Real Estate Securities werden Dividenden vierteljährlich erklärt und innerhalb von dreißig Geschäftstagen gezahlt;
- (f) bei allen anderen ausschüttenden Klassen des US Long Short Equity ist beabsichtigt, dass etwaige Dividenden halbjährlich erklärt und innerhalb von dreißig Geschäftstagen gezahlt werden;
- (g) Ausschüttungen der anderen ausschüttenden Klassen des Uncorrelated Strategies, des US Equity, des US Large Cap Value, des US Multi Cap Opportunities, des US Small Cap und des US Small Cap Intrinsic Value werden jährlich erklärt und innerhalb von dreißig Geschäftstagen gezahlt;
- (h) bei allen anderen ausschüttenden Klassen aller anderen Portfolios ist beabsichtigt, dass etwaige Dividenden auf jährlicher Basis festgesetzt und innerhalb von dreißig Geschäftstagen in Bezug auf den Nettoertrag der ausschüttenden Klassen für das am vorhergehenden 31. Dezember abgelaufene Kalenderjahr gezahlt werden;
- (i) Bei allen (monatlich) Bruttoerträge ausschüttenden Klassen in den Portfolios werden Dividenden am oder vor dem letzten Geschäftstag eines jeden Monats festgesetzt und innerhalb von drei Geschäftstagen gezahlt; und
- (j) bei allen übrigen (Brutto-)Erträge ausschüttenden Klassen in den Portfolios werden Dividenden auf vierteljährlicher Basis festgesetzt und innerhalb von dreißig Geschäftstagen gezahlt.

Unter dem Vorbehalt, dass Erträge zur Ausschüttung zur Verfügung stehen, können die Direktoren auch beschließen, für jede der ausschüttenden Klassen Zwischendividenden festzusetzen und auszuschütten. Alle Anteile einer ausschüttenden Klasse, die an einem Datum, an dem die Direktoren beschließen, für diese ausschüttende Klasse eine Dividende festzusetzen, ausgegeben sind, haben Anspruch auf diese Dividende.

Die Direktoren behalten sich das Recht vor, die Dividendenpolitik jeder Anteilklasse nach ihrem eigenen Ermessen ohne vorherige Mitteilung an die Anteilhaber der betreffenden Klasse zu ändern. Jede Dividende, die nicht innerhalb eines Zeitraums von sechs Jahren ab dem Datum des Dividendenbeschlusses in Anspruch genommen wird, verjährt und fällt dem jeweiligen Portfolio wieder zu.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET

| | 5G Connectivity | | Absolute Return Multi Strategy* | |
|---|-----------------------|-----------------------|---------------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | Zeitwert | Zeitwert | Zeitwert | Zeitwert |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Aktien | 990.515.308 | 952.894.719 | 6.311 | 6.766 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | 6.342.222 | 12.141.765 | – | – |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 996.857.530 | 965.036.484 | 6.311 | 6.766 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | (1.033.321) | (3.280.059) | – | – |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (1.033.321) | (3.280.059) | – | – |

* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

| | China A-Share Equity | | China Bond | |
|---|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | Zeitwert CNY | Zeitwert CNY | Zeitwert CNY | Zeitwert CNY |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Einlagenzertifikat | – | – | 58.557.000 | 92.924.345 |
| Unternehmensanleihen | – | – | 290.154.114 | 272.165.839 |
| Aktien | 13.480.937 | 15.317.693 | – | – |
| Staatsanleihen | – | – | 95.858.682 | 60.073.670 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | – | – | 603.582 | – |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | – | 1.943.751 | 3.921.557 |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 13.480.937 | 15.317.693 | 447.117.129 | 429.085.411 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | – | – | – | (37.837) |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | – | (2.361.945) | (2.701.843) |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | – | – | (2.361.945) | (2.739.680) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

| | China Equity | | Climate Innovation ¹ | |
|---|-----------------------|-----------------------|---------------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | Zeitwert | Zeitwert | Zeitwert | Zeitwert |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Aktien | 171.916.351 | 306.849.688 | 2.831.398 | – |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | 547.220 | 1.099.861 | – | – |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 172.463.571 | 307.949.549 | 2.831.398 | – |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | (423.344) | (817.712) | – | – |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (423.344) | (817.712) | – | – |

¹ Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

| | CLO Income | | Commodities ² | |
|---|-----------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | Zeitwert | Zeitwert | Zeitwert | Zeitwert |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Agency Bonds | – | – | – | 10.530.836 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | 159.687.075 | 112.870.953 | – | – |
| Unternehmensanleihen | – | – | 77.031.796 | 26.223.262 |
| Investmentfonds | 12.221.060 | – | – | – |
| Schatzwechsel | 4.994.906 | – | 43.941.161 | 39.453.874 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | 2.345.289 | 3.267.421 | 1.573.388 | 1.519.496 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten | 48.732 | – | – | – |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 179.297.062 | 116.138.374 | 122.546.345 | 77.727.468 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | (2.570.754) | (989.846) | (210.126) | (333.046) |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten | – | (334.323) | – | – |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (2.570.754) | (1.324.169) | (210.126) | (333.046) |

² Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

| | Corporate Hybrid Bond | | Developed Market FMP – 2027 ¹ |
|---|-----------------------|-----------------------|--|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 |
| | Zeitwert | Zeitwert | Zeitwert |
| | EUR | EUR | US\$ |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | |
| Unternehmensanleihen | 1.743.583.625 | 1.638.001.345 | 135.777.186 |
| Investmentfonds | 10.956.412 | 10.317.170 | – |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | 12.101.176 | 36.511.573 | 39.869 |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 1.766.641.213 | 1.684.830.088 | 135.817.055 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | – | (37.445.575) | – |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | (7.732.130) | (20.223.334) | (393) |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (7.732.130) | (57.668.909) | (393) |

¹ Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

| | Emerging Market Debt - Hard Currency | | Emerging Market Debt - Local Currency | |
|---|--------------------------------------|-----------------------|---------------------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Einlagenzertifikat | – | – | – | 18.492.177 |
| Unternehmensanleihen | 732.442.764 | 784.977.470 | 41.825.600 | 22.468.723 |
| Staatsanleihen | 1.794.182.602 | 1.508.020.941 | 1.124.421.834 | 1.280.353.016 |
| Investmentfonds | 17.580.000 | 16.110.000 | 16.173.300 | 15.136.550 |
| Schatzwechsel | – | – | 33.341.150 | – |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 19.568.314 | 23.148.647 | 313.668 | – |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | 24.839.124 | 12.379.899 | 17.116.276 | 14.987.459 |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | – | 1.909.636 | – | – |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten | – | – | 11.479.756 | 8.845.584 |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 2.588.612.804 | 2.346.546.593 | 1.244.671.584 | 1.360.283.509 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (10.222.785) | (1.308.787) | (716.676) | (676.393) |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | (5.652.118) | (10.560.096) | (12.281.584) | (9.665.447) |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten | – | – | (14.977.755) | (47.106.454) |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (15.874.903) | (11.868.883) | (27.976.015) | (57.448.294) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

| | Emerging Market Debt Blend | | Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | |
|---|----------------------------|-----------------------|---|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Unternehmensanleihen | 148.077.852 | 149.902.253 | 9.239.606 | 7.512.041 |
| Staatsanleihen | 330.568.106 | 288.112.593 | 48.266.565 | 42.285.874 |
| Investmentfonds | 14.297.035 | 13.380.558 | – | – |
| Schatzwechsel | 1.006.392 | – | 821.151 | – |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 1.199.361 | 1.175.800 | 832.110 | 610.127 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | 6.637.946 | 4.031.358 | 2.325.031 | 446.879 |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | – | 1.658.685 | – | – |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten | 2.641.912 | 4.841.085 | 19.138 | 43.385 |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 504.428.604 | 463.102.332 | 61.503.601 | 50.898.306 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (969.525) | (159.705) | (356.901) | (65.989) |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | (2.075.226) | (2.058.976) | (284.238) | (340.697) |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten | (5.804.925) | (11.561.405) | (38.443) | (135.722) |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (8.849.676) | (13.780.086) | (679.582) | (542.408) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

| | Emerging Markets Equity | | Emerging Markets Select Equity* | |
|---|-------------------------|-----------------------|---------------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Aktien | 87.302.700 | 188.734.006 | – | 90.426.979 |
| Immobilienaktiengesellschaften | 481.105 | – | – | – |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | 1.272.409 | 1.053.813 | – | – |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 89.056.214 | 189.787.819 | – | 90.426.979 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | (787.152) | (666.859) | – | – |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (787.152) | (666.859) | – | – |

* Das Portfolio wurde am 7. September 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

| | Euro Bond | | Euro Bond Absolute Return | |
|---|-----------------------|-----------------------|---------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | Zeitwert EUR | Zeitwert EUR | Zeitwert EUR | Zeitwert EUR |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | 4.100 | 462.816 | 158.727 | 2.319.216 |
| Unternehmensanleihen | 4.770.071 | 4.079.176 | 18.558.164 | 23.938.251 |
| Staatsanleihen | 5.399.389 | 4.005.023 | 14.456.150 | 19.650.553 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 32.300 | 41.432 | 47.035 | 1.497.736 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | – | 25.383 | 39.745 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten | 6.642 | 93 | 26.569 | 61.989 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten | 7.001 | 1.858 | 113.881 | 12.884 |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 10.219.503 | 8.590.398 | 33.385.909 | 47.520.374 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (19.007) | (82.010) | (301.831) | (103.516) |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | – | (1.117.757) | (1.032.074) |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | (54.486) | (6.528) | (181.087) | (32.637) |
| Nicht realisierter Verlust aus Inflation-Swap-Kontrakten | (3.665) | – | (14.661) | (67.569) |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten | (3.982) | (23.909) | – | (43.820) |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (81.140) | (112.447) | (1.615.336) | (1.279.616) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

| | European High Yield Bond | | European Sustainable Equity | |
|---|--------------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | Zeitwert EUR | Zeitwert EUR | Zeitwert EUR | Zeitwert EUR |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | 2.425.341 | 215.121 | – | – |
| Unternehmensanleihen | 384.433.736 | 32.065.000 | – | – |
| Aktien | – | – | 171.225.790 | 174.388.827 |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen | 114.727 | 202.519 | – | – |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | 643.091 | 1.258.544 | – | – |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten | 18.355 | – | – | – |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 387.635.250 | 33.741.184 | 171.225.790 | 174.388.827 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | (1.281.452) | (3.113.019) | – | – |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (1.281.452) | (3.113.019) | – | – |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

| | Event Driven ² | | Global Bond | |
|---|---------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | Zeitwert | Zeitwert | Zeitwert | Zeitwert |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Agency Bonds | – | – | 1.146.538 | 2.423.190 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | – | – | 10.864.506 | 8.861.707 |
| Unternehmensanleihen | – | – | 28.855.602 | 44.359.194 |
| Staatsanleihen | – | – | 42.481.574 | 53.670.009 |
| Mortgage-Backed Securities | – | – | 22.645.649 | 19.062.981 |
| Kommunalanleihen | – | – | 1.278.776 | 1.706.806 |
| Schatzwechsel | 115.039.719 | 33.823.354 | – | 791.814 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | – | – | 440.690 | 270.257 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | 4.057.943 | 918.069 | 3.337.129 | 2.638.428 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten | – | – | 124.708 | 1.233 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten | 959.529 | 18.364 | – | – |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 120.057.191 | 34.759.787 | 111.175.172 | 133.785.619 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | – | – | (622.972) | (191.230) |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | (155.365) | (18.616) | (3.195.228) | (1.908.377) |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | – | – | (72.291) | (13.185) |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (155.365) | (18.616) | (3.890.491) | (2.112.792) |

² Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

| | Global Diversified Income FMP – 2024 | | Global Equity Megatrends | |
|---|--------------------------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Unternehmensanleihen | 123.463.985 | 150.336.737 | – | – |
| Aktien | – | – | 141.492.601 | 79.465.335 |
| Staatsanleihen | 1.727.993 | 3.931.136 | – | – |
| Schatzwechsel | 18.765.889 | – | – | – |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | 281.732 | 523.987 | 444 | – |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 144.239.599 | 154.791.860 | 141.493.045 | 79.465.335 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (417) | – | – |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | – | (417) | – | – |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

| | Global Flexible Credit Income | | Global High Yield SDG Engagement | |
|---|-------------------------------|-----------------------|----------------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | 23.118.219 | 24.079.041 | – | – |
| Unternehmensanleihen | 296.273.462 | 316.164.124 | 532.499.481 | 273.005.334 |
| Aktien | 6.022.083 | 5.247.334 | – | – |
| Staatsanleihen | 15.379.748 | 9.817.787 | – | – |
| Investmentfonds | 66.832 | 338.564 | – | – |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen | 15.105.874 | – | 4.933 | 1.013.476 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 3.733.739 | 468.202 | – | – |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | 8.130.820 | 29.033.515 | 11.935.674 | 12.873.530 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten | 268.263 | – | – | 13.411 |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 368.099.040 | 385.148.567 | 544.440.088 | 286.905.751 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (5.173.223) | (515.955) | – | – |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | (3.447.658) | (10.857.921) | (6.738.234) | (9.426.254) |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten | – | (632.100) | – | – |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (8.620.881) | (12.005.976) | (6.738.234) | (9.426.254) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

| | Global High Yield Sustainable Action* | | Global Investment Grade Credit | |
|---|---------------------------------------|-----------------------|--------------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | Zeitwert | Zeitwert | Zeitwert | Zeitwert |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Unternehmensanleihen | – | 14.443.671 | 81.376.321 | 80.767.363 |
| Staatsanleihen | – | – | 2.082.454 | 2.758.010 |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen | – | 95.881 | – | – |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 7.620 | 1.115 | 16.124 |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | – | 14.547.172 | 83.459.890 | 83.541.497 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (358.029) | (1.107.450) | (1.642.819) |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | – | (358.029) | (1.107.450) | (1.642.819) |

* Das Portfolio wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

| | Global Opportunistic Bond | | Global Real Estate Securities | |
|---|---------------------------|-----------------------|-------------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Agency Bonds | – | 307.820 | – | – |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | 1.817.743 | 4.290.102 | – | – |
| Unternehmensanleihen | 27.412.055 | 35.431.699 | – | – |
| Aktien | – | – | 3.015.990 | 6.846.055 |
| Staatsanleihen | 21.133.383 | 24.711.043 | – | – |
| Investmentfonds | 21.165 | 1.801.216 | – | – |
| Mortgage-Backed Securities | 14.565.802 | 10.458.233 | – | – |
| Immobilienaktiengesellschaften | – | – | 17.071.668 | 30.360.798 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 839.044 | 568.616 | – | – |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | 4.673.609 | 2.069.747 | 422.478 | 866.015 |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | 193.716 | 455.060 | – | – |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten | 76 | 17.416 | – | – |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 70.656.593 | 80.110.952 | 20.510.136 | 38.072.868 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (356.573) | (607.164) | – | – |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | (6.577.836) | (4.857.533) | (250.684) | (147.763) |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | (821.571) | (64.729) | – | – |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten | (27) | (141) | – | – |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (7.756.007) | (5.529.567) | (250.684) | (147.763) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

| | Global Sustainable Equity | | Global Sustainable Value | |
|---|---------------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Aktien | 153.603.419 | 130.524.482 | 53.809.071 | 46.960.389 |
| Immobilienaktiengesellschaften | – | – | 1.116.404 | 755.437 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | – | 66.448 | 125.312 |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 153.603.419 | 130.524.482 | 54.991.923 | 47.841.138 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | – | (46.897) | (90.456) |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | – | – | (46.897) | (90.456) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

| | High Yield Bond | | InnovAsia 5G | |
|---|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | Zeitwert | Zeitwert | Zeitwert | Zeitwert |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | 10.897.982 | 21.830.306 | – | – |
| Unternehmensanleihen | 1.999.177.351 | 1.982.553.426 | – | – |
| Aktien | – | – | 22.524.887 | 13.872.508 |
| Staatsanleihen | 36.225.768 | – | – | – |
| Investmentfonds | 3.611.285 | 18.294.706 | – | – |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen | 43.084.058 | 91.635.501 | – | – |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | 40.709.223 | 55.707.544 | 299.135 | 453.339 |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 2.133.705.667 | 2.170.021.483 | 22.824.022 | 14.325.847 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | (15.391.406) | (25.192.706) | (60.136) | (78.732) |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten | (51.928) | (404.963) | – | – |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (15.443.334) | (25.597.669) | (60.136) | (78.732) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

| | Japan Equity Engagement | | Macro Opportunities FX | |
|---|-------------------------|-----------------------|------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | Zeitwert JPY | Zeitwert JPY | Zeitwert EUR | Zeitwert EUR |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Unternehmensanleihen | – | – | – | 24.967.521 |
| Aktien | 15.961.893.000 | 20.207.455.300 | – | – |
| Staatsanleihen | – | – | 347.166 | 2.778.639 |
| Schatzwechsel | – | – | 2.407.376 | 4.389.983 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | 128.484.079 | 44.531.344 | 4.627.295 | 3.617.207 |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 16.090.377.079 | 20.251.986.644 | 7.381.837 | 35.753.350 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | (42.002.252) | (141.215.249) | (4.613.695) | (4.428.576) |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (42.002.252) | (141.215.249) | (4.613.695) | (4.428.576) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

| | Multi-Asset Income* | | Next Generation Mobility | |
|---|-----------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Agency Bonds | – | 7.644 | – | – |
| Unternehmensanleihen | – | 4.880.908 | – | – |
| Aktien | – | 2.848.448 | 151.194.636 | 136.877.785 |
| Staatsanleihen | – | 311.601 | – | – |
| Investmentfonds | – | 602.185 | – | – |
| Immobilienaktiengesellschaften | – | 364.808 | 1.619.728 | 1.522.531 |
| Gekaufte Optionskontrakte | – | 4.207 | – | – |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | – | 51.032 | – | – |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 160.435 | 20.789 | 294.328 |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | – | 9.231.268 | 152.835.153 | 138.694.644 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Verkaufte Optionskontrakte | – | (59.717) | – | – |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | – | (2.994) | – | – |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (584.335) | (10.365) | (213.661) |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | – | (647.046) | (10.365) | (213.661) |

* Das Portfolio wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

| | Next Generation Space Economy ² | | Responsible Asian Debt - Hard Currency | |
|---|--|-----------------------|--|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Unternehmensanleihen | – | – | 45.692.223 | 18.090.069 |
| Aktien | 18.674.716 | 7.981.674 | – | – |
| Staatsanleihen | – | – | 12.025.196 | 2.090.986 |
| Schatzwechsel | – | – | 2.496.736 | – |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | – | – | 255.858 | 47.079 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | – | 127.055 | 34.382 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten | – | – | 575 | – |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 18.674.716 | 7.981.674 | 60.597.643 | 20.262.516 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | – | – | (128.113) | (3.440) |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | – | (135.330) | (84.733) |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten | – | – | (21) | – |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | – | – | (263.464) | (88.173) |

² Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

| | Short Duration Emerging Market Debt | | Short Duration High Yield SDG Engagement | |
|---|-------------------------------------|-----------------------|--|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Unternehmensanleihen | 2.406.487.373 | 3.527.685.607 | 664.013.737 | 477.638.711 |
| Staatsanleihen | 1.307.631.941 | 1.205.827.702 | – | – |
| Investmentfonds | 49.810.000 | 70.347.000 | 241.028 | 1.221.039 |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen | – | – | 13.420.047 | 23.578.927 |
| Schatzwechsel | 53.894.704 | 51.075.667 | – | 10.810.063 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | 64.552.046 | 46.700.064 | 15.254.920 | 23.012.144 |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 3.882.376.064 | 4.901.636.040 | 692.929.732 | 536.260.884 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | – | (1.843.240) | – | – |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | (9.131.675) | (23.986.773) | (3.114.085) | (5.286.451) |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (9.131.675) | (25.830.013) | (3.114.085) | (5.286.451) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

| | Strategic Income | | Sustainable Asia High Yield | |
|--|-----------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Agency Bonds | 781.434 | 772.053 | – | – |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | 211.031.917 | 105.467.359 | – | – |
| Unternehmensanleihen | 535.844.310 | 637.567.177 | 24.364.117 | 27.495.016 |
| Aktien | 22.512 | – | – | – |
| Staatsanleihen | 175.669.880 | 243.357.365 | 2.505.094 | 837.924 |
| Investmentfonds | 60.766.454 | 58.225.837 | – | – |
| Mortgage-Backed Securities | 918.338.562 | 346.893.475 | – | – |
| Kommunalanleihen | 12.918.823 | 20.744.098 | – | – |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen | 429.819 | 579.804 | – | – |
| Schatzwechsel | 221.166.130 | 8.017.122 | – | – |
| Gekaufte Swaptions | 15.122 | – | – | – |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 3.637.375 | 2.904.814 | 23.897 | 13.122 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | 20.251.351 | 29.520.687 | 16.926 | 282.337 |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | 905.422 | 25.894 | – | – |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten | 834.927 | 451.266 | – | – |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten | 461.585 | – | – | – |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 2.163.075.623 | 1.454.526.951 | 26.910.034 | 28.628.399 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

| | Strategic Income (Fortsetzung) | | Sustainable Asia High Yield (Fortsetzung) | |
|---|--------------------------------|-----------------------|---|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (18.576.468) | (1.425.842) | (58.271) | – |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | (5.513.615) | (7.161.491) | (496) | (29.229) |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | – | (97.587) | – | – |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten | (1.085.681) | (916.187) | – | – |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten | – | (3.863.949) | – | – |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (25.175.764) | (13.465.056) | (58.767) | (29.229) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

| | Sustainable Emerging Market Corporate Debt | | Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency ² | |
|---|--|-----------------------|---|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | Zeitwert | Zeitwert | Zeitwert | Zeitwert |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Unternehmensanleihen | 83.464.415 | 86.982.672 | 28.120.429 | 7.708.197 |
| Staatsanleihen | 7.168.384 | 4.401.408 | 387.681.779 | 136.106.159 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 27.031 | 49.937 | 7.590.987 | 2.512.729 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | 1.906.675 | 853.222 | 8.781.301 | 1.237.337 |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | – | – | – | 53.826 |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 92.566.505 | 92.287.239 | 432.174.496 | 147.618.248 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (236.161) | (7.617) | (3.655.629) | (46.430) |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | (235.957) | (134.345) | (2.051.066) | (862.058) |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (472.118) | (141.962) | (5.706.695) | (908.488) |

² Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

| | Tactical Macro ¹ | Ultra Short Term Euro Bond | |
|---|-----------------------------|----------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | Zeitwert | Zeitwert | Zeitwert |
| | US\$ | EUR | EUR |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | – | 90.687.160 | 72.343.961 |
| Unternehmensanleihen | – | 789.167.617 | 670.503.994 |
| Staatsanleihen | – | 75.386.047 | 56.450.113 |
| Schatzwechsel | 22.994.103 | 8.960.964 | – |
| Gekaufte Optionskontrakte | 359.299 | – | – |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 8.973 | 509.420 | 9.402.701 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | 67.331 | 235.719 | 232.108 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten | – | 531.378 | 9.296 |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 23.429.706 | 965.478.305 | 808.942.173 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | |
| Verkaufte Optionskontrakte | (197.253) | – | – |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (28.337) | (2.783.686) | (1.719.108) |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | (36.811) | (2.512.078) | (6.570.781) |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | – | (2.179.454) | (543.950) |
| Nicht realisierter Verlust aus Inflation-Swap-Kontrakten | – | (293.227) | – |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten | – | (248.422) | (1.735.988) |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (262.401) | (8.016.867) | (10.569.827) |

¹ Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

| | Uncorrelated Strategies | | Uncorrelated Trading ^{2*} | |
|--|-------------------------|-----------------------|------------------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Unternehmensanleihen | 120.618.827 | 161.387.060 | - | 13.221.435 |
| Aktien | 77.292.452 | 135.368.028 | - | 16.089.324 |
| Immobilienaktiengesellschaften | 1.217.656 | 4.976.282 | - | 3.946.436 |
| Participatory Notes | 37.045 | 21.440 | - | - |
| Staatsanleihen | 38.964.571 | 4.218.750 | - | - |
| Schatzwechsel | 707.195.701 | 1.582.793.462 | - | 449.200.010 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Differenzkontrakten | 106.923.561 | 78.118.012 | - | 13.934.583 |
| Gekaufte Optionskontrakte | 283.236.382 | 202.760.196 | - | 35.858.570 |
| Gekaufte Swaptions | 40.202 | 1.388.392 | - | 68.848 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 18.420.818 | 40.643.851 | - | 8.521.839 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | 91.871.867 | 212.294.005 | - | 54.485.356 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten | 3.395.463 | 3.899.449 | - | 678.244 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Correlation-Swap-Kontrakten | 379.911 | 700.944 | - | - |
| Nicht realisierter Gewinn aus Variance-Swap-Kontrakten | 3.828.212 | 971.550 | - | 319.127 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Volatility-Swap-Kontrakten | 18.426.175 | 32.121.676 | - | 1.343.255 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten | 3.727.082 | 65.682.162 | - | 1.024.404 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten | - | 27.160.802 | - | - |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | 686.246 | 1.435.658 | - | - |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 1.476.262.171 | 2.555.941.719 | - | 598.691.431 |

² Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

* Das Portfolio wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

| | Uncorrelated Strategies (Fortsetzung) | | Uncorrelated Trading ^{2*} (Fortsetzung) | |
|---|---------------------------------------|-----------------------|--|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Differenzkontrakten | (20.691.238) | (58.716.225) | - | (3.269.736) |
| Verkaufte Optionskontrakte | (378.717.224) | (309.983.118) | - | (42.460.180) |
| Verkaufte Swaptionen | (29.043) | (708.024) | - | (20.738) |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (24.593.398) | (25.288.052) | - | (4.922.598) |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | (53.084.382) | (37.812.332) | - | (6.317.151) |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten | (9.089.737) | (23.945.145) | - | (1.000.582) |
| Nicht realisierter Verlust aus Inflation-Swap-Kontrakten | - | (26.861.904) | - | - |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | (1.305.860) | (526.998) | - | (47.926) |
| Nicht realisierter Verlust aus Correlation-Swap-Kontrakten | - | (60.576) | - | - |
| Nicht realisierter Verlust aus Variance-Swap-Kontrakten | (514.676) | (421.247) | - | (332.219) |
| Nicht realisierter Verlust aus Volatility-Swap-Kontrakten | (8.911.489) | (4.417.825) | - | (939.941) |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten | (3.021.166) | (1.242.422) | - | (13.154) |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (499.958.213) | (489.983.868) | - | (59.324.225) |

² Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

* Das Portfolio wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

| | US Equity | | US Equity Index PutWrite | |
|---|-----------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Aktien | 45.872.647 | 27.005.260 | – | – |
| Staatsanleihen | – | – | 663.357.136 | 632.264.076 |
| Immobilienaktiengesellschaften | – | 478.769 | – | – |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | 1.253.492 | 2.158.080 | 12.128.805 | 16.592.327 |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 47.126.139 | 29.642.109 | 675.485.941 | 648.856.403 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Verkaufte Optionskontrakte | – | – | (5.251.795) | (12.932.325) |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | (118.963) | (546.931) | (538.104) | (1.350.871) |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (118.963) | (546.931) | (5.789.899) | (14.283.196) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

| | US Large Cap Value | | US Long Short Equity | |
|---|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | Zeitwert | Zeitwert | Zeitwert | Zeitwert |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Unternehmensanleihen | – | – | 7.670.535 | 8.400.448 |
| Aktien | 1.847.675.317 | 1.688.625.847 | 166.583.403 | 158.010.330 |
| Participatory Notes | – | – | – | 3.750 |
| Immobilienaktiengesellschaften | 3.901.309 | – | 3.534.047 | 1.744.930 |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen | – | – | 487.831 | – |
| Differenzkontrakte | – | – | 624.429 | 3.162.728 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | – | – | – | 470.254 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | 1.119.012 | 973.737 | 3.283.704 | 6.686.844 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten | – | – | – | 664.406 |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 1.852.695.638 | 1.689.599.584 | 182.183.949 | 179.143.690 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Differenzkontrakte | – | – | (2.740.096) | (1.291.811) |
| Verkaufte Optionskontrakte | – | – | (15.714) | (74.360) |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | – | – | (1.003.428) | – |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | (115.827) | (102.612) | (342.870) | (822.791) |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten | – | – | (4.635.993) | (700.901) |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (115.827) | (102.612) | (8.738.101) | (2.889.863) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

| | US Multi Cap Opportunities | | US Real Estate Securities | |
|---|----------------------------|-----------------------|---------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Aktien | 396.982.739 | 439.025.865 | – | – |
| Immobilienaktiengesellschaften | – | – | 519.992.632 | 624.531.489 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | 1.843.892 | 2.736.142 | 2.358.847 | 4.089.640 |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 398.826.631 | 441.762.007 | 522.351.479 | 628.621.129 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | (325.170) | (587.402) | (441.683) | (1.230.032) |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (325.170) | (587.402) | (441.683) | (1.230.032) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

| | US Small Cap | | US Small Cap Intrinsic Value | |
|---|-----------------------|-----------------------|------------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ | Zeitwert US\$ |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Aktien | 622.291.910 | 578.779.674 | 299.826.372 | 184.718.734 |
| Immobilienaktiengesellschaften | – | – | 1.910.421 | 2.170.638 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | 747.370 | 949.457 | – | – |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | 623.039.280 | 579.729.131 | 301.736.793 | 186.889.372 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | (137.144) | (236.699) | (398) | – |
| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten | (137.144) | (236.699) | (398) | – |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE

Alle Kassenbestände werden bei Brown Brothers Harriman & Co. oder bei vom Fonds genehmigten Drittinstituten als Tagesgeldeinlagen oder direkt bei einer Unterdepotbank gehalten. In den nachfolgenden Tabellen ist das Risiko aufgeführt, dem der Fonds durch die aufgeführten Institute mit seinen Bareinlagen am 31. Dezember 2023 und am 31. Dezember 2022 ausgesetzt war.

| | 5G Connectivity | | Absolute Return Multi Strategy* | | China A-Share Equity | |
|---|-----------------------|-----------------------|---------------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| ANZ Bank, Hong Kong | - | - | - | - | 10.286 | - |
| ANZ Bank, London | - | 5 | 7.009 | 3.884 | - | - |
| Bank of Montreal, London | - | - | 7.012 | - | - | - |
| Bank of Nova Scotia, Toronto | - | - | 7.009 | 3.884 | - | - |
| BBH, Grand Cayman | - | 2 | - | 63.136 | - | - |
| BBH, New York | - | - | 42.344 | - | - | - |
| Brown Brothers Harriman & Co | 194.032 | 95.330 | 425 | 337 | 1.064.042 | 947.616 |
| Canadian Imperial Bank of Commerce, Toronto | - | - | - | - | - | - |
| Citibank, New York | 43.447.745 | 34.022.865 | 7.012 | 2.651 | - | - |
| DNB, Oslo | - | - | 6 | - | - | - |
| HSBC Bank Plc, Hong Kong | 601 | 402 | - | - | - | 4.836 |
| HSBC Bank Plc, London | 5 | - | - | - | - | - |
| JPMorgan Chase, New York | - | - | 7.009 | 3.884 | - | 478 |
| National Australia Bank, London | - | - | - | 3.751 | - | - |
| Royal Bank of Canada, Toronto | - | - | 7.012 | 3.884 | - | - |
| Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm | - | - | 7.009 | 3.884 | - | - |
| Sumitomo, Tokyo | 1.479 | 1.050 | 7.012 | 3.884 | 517 | - |
| Insgesamt | 43.643.862 | 34.119.654 | 98.859 | 93.179 | 1.074.845 | 952.930 |

* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

| | China Bond | | China Equity | | Climate Innovation ¹ | |
|--|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|---------------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | CNY | CNY | CNY | CNY | US\$ | US\$ |
| ANZ Bank, Hong Kong | - | - | - | - | 2 | - |
| Bank of Montreal, London | 4.780.550 | - | - | - | - | - |
| BBH, Grand Cayman | - | 4 | - | - | - | - |
| BBH, New York | 4 | - | - | - | - | - |
| Brown Brothers Harriman & Co | 4.665.103 | 22.349.396 | 2.865.781 | 2.089.537 | 364 | - |
| Citibank, New York | - | 437.578 | - | 346.391 | 83.482 | - |
| DNB, Oslo | - | - | - | - | 27 | - |
| HSBC Bank Plc, Hong Kong | - | - | 2.907.393 | 6.109.128 | - | - |
| Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm | 954 | - | 244.016 | - | - | - |
| Sumitomo, Tokyo | - | 1.979 | - | - | - | - |
| Insgesamt | 9.446.611 | 22.788.957 | 6.017.190 | 8.545.056 | 83.875 | - |

¹ Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

| | CLO Income | | Commodities ² | | Corporate Hybrid Bond | |
|--|-----------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | EUR | EUR |
| Bank of Montreal, London | - | - | 684.552 | - | - | - |
| Barclays Bank, London | - | - | - | - | - | 21.252.082 |
| BBH, Grand Cayman | - | - | - | - | - | 1 |
| Brown Brothers Harriman & Co | 51.817 | 44.379 | 92.067 | 46.258 | 342.084 | 297.452 |
| Citibank, New York | 12.233.975 | 9.657.697 | 10.810.004 | 5.975.120 | 39.076.989 | - |
| DNB, Oslo | - | - | - | - | 1.341.143 | - |
| HSBC Bank Plc, London | - | - | - | - | 38.663.608 | - |
| JPMorgan Chase, New York | - | 984.125 | 10.810.004 | - | - | 83.168.999 |
| Royal Bank of Canada, Toronto | - | - | - | 2.073.620 | - | - |
| Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm | - | 9.657.697 | - | - | - | - |
| Sumitomo, Tokyo | 1.418 | 5.897 | 10.810.004 | - | - | 20.246.629 |
| Insgesamt | 12.287.210 | 20.349.795 | 33.206.631 | 8.094.998 | 79.423.824 | 124.965.163 |

² Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

| | Developed Market FMP – 2027 ¹ | | Emerging Market Debt - Hard Currency | | Emerging Market Debt - Local Currency | |
|--|--|-----------------------|--------------------------------------|-----------------------|---------------------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Bank of Nova Scotia, Toronto | - | - | - | 17.655.809 | 839 | 788 |
| Barclays Bank, London | - | - | 29 | - | - | - |
| BBH, Grand Cayman | - | - | - | 1 | - | - |
| BNP Paribas, Paris | - | - | 16 | - | - | 379 |
| Brown Brothers Harriman & Co | 1.653 | - | 8.540 | 285.028 | 1.021.127 | 1.999.950 |
| Citibank, New York | - | - | - | - | - | 10.175.191 |
| DNB, Oslo | - | - | 2.297.690 | - | 2 | - |
| HSBC Bank Plc, Hong Kong | - | - | - | - | 2 | 225.273 |
| HSBC Bank Plc, London | - | - | - | - | - | 4 |
| JPMorgan Chase, New York | 501.784 | - | - | - | - | - |
| Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm | - | - | - | - | 4 | - |
| Sumitomo, Tokyo | - | - | - | 89.983.319 | 33.877.656 | - |
| Insgesamt | 503.437 | - | 2.306.275 | 107.924.157 | 34.899.630 | 12.401.585 |

¹ Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

| | Emerging Market Debt Blend | | Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | | Emerging Markets Equity | |
|--|----------------------------|-----------------------|---|-----------------------|-------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| ANZ Bank, London | - | 3.598 | - | - | - | 24 |
| ANZ Bank, Hong Kong | - | - | - | - | 571 | - |
| Bank of Nova Scotia, Toronto | 279 | 262 | 2 | 1 | 6.154 | 15.773 |
| BBH, Grand Cayman | - | 1 | - | - | - | - |
| BNP Paribas, Paris | 28 | 421.660 | - | - | 267 | 231 |
| Brown Brothers Harriman & Co | 412.150 | 838.790 | 33.259 | 49.801 | 375.937 | 190.441 |
| Credit Suisse AG, Zurich | - | 25 | - | - | - | - |
| DNB, Oslo | - | - | - | - | 3 | - |
| HSBC Bank Plc, Hong Kong | 2 | 168.430 | - | - | 2 | 355 |
| JPMorgan Chase, New York | - | 1.367.719 | - | 3.167.510 | - | 5.149.468 |
| Nordea Bank, Oslo | - | - | 7 | 7 | - | - |
| Royal Bank of Canada, Toronto | 14.175.872 | - | - | - | - | - |
| Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm | 3.946 | - | 2.600.660 | - | 2.913.245 | - |
| Sumitomo, Tokyo | 503.538 | 1.234.517 | 120.150 | 195.752 | 3 | 3 |
| Insgesamt | 15.095.815 | 4.035.002 | 2.754.078 | 3.413.071 | 3.296.182 | 5.356.295 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

| | Emerging Markets Select Equity* | | Euro Bond | | Euro Bond Absolute Return | |
|--|---------------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|---------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | EUR | EUR |
| ANZ Bank, London | 7.479 | - | - | - | - | - |
| Bank of Montreal, London | 7.479 | - | - | - | - | - |
| Bank of Nova Scotia, Toronto | 7.479 | 7 | - | - | - | - |
| BBH, Grand Cayman | - | 2 | - | - | - | - |
| BBH, New York | 99.428 | - | - | - | - | - |
| BNP Paribas, Paris | - | 77 | - | - | - | - |
| Brown Brothers Harriman & Co | 4.706 | 56.551 | 447 | 145 | 1.384 | 1.052 |
| Citibank, London | - | - | - | 473.003 | 72.050 | - |
| Citibank, New York | 7.479 | - | - | - | 27.840 | - |
| HSBC Bank Plc, Hong Kong | 6 | 484 | - | - | - | - |
| JPMorgan Chase, New York | 7.479 | 3.345.805 | - | - | - | - |
| Royal Bank of Canada, Toronto | 7.479 | - | - | - | - | 15.670 |
| Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm | 7.479 | - | - | - | 359.043 | - |
| Sumitomo, Tokyo | 7.479 | 5 | 127.229 | - | - | 1.694.020 |
| Insgesamt | 163.972 | 3.402.931 | 127.676 | 473.148 | 460.317 | 1.710.742 |

* Das Portfolio wurde am 7. September 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

| | European High Yield Bond | | European Sustainable Equity | | Event Driven ² | |
|--|--------------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------------------|---------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | EUR | EUR | EUR | EUR | US\$ | US\$ |
| ANZ Bank, London | - | - | - | 24 | - | 1.047.071 |
| BBH, Grand Cayman | - | - | - | 10 | - | - |
| BNP Paribas, Paris | - | - | 121 | - | - | - |
| Brown Brothers Harriman & Co | 56.985 | 3.356 | 2.807 | 451 | 46.874 | 21.102 |
| Citibank, New York | - | - | - | - | 8.836.292 | 2.901.931 |
| Credit Suisse AG, Zurich | - | - | - | 23 | - | - |
| DNB, Oslo | - | - | 101 | - | - | - |
| HSBC Bank Plc, Hong Kong | 1 | 1 | - | - | - | - |
| HSBC Bank Plc, London | - | - | - | - | 2.014 | 1.928 |
| JPMorgan Chase, New York | - | - | - | - | 4.614.996 | 2.901.931 |
| Nordea Bank, Oslo | - | - | - | 22 | - | - |
| Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm | - | 419.586 | 143 | 37 | - | - |
| Sumitomo, Tokyo | 16.567.542 | 949.253 | 1.124.096 | 1.487.045 | - | - |
| Insgesamt | 16.624.528 | 1.372.196 | 1.127.268 | 1.487.612 | 13.500.176 | 6.873.963 |

² Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

| | Global Bond | | Global Diversified Income FMP – 2024 | | Global Equity Megatrends | |
|--|-----------------------|-----------------------|--------------------------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| ANZ Bank, Hong Kong | 5.105 | - | - | - | - | - |
| ANZ Bank, London | - | 4.997 | - | 5.320.556 | - | - |
| Bank of Nova Scotia, Toronto | 292.499 | 299.876 | - | 11.223.942 | 31 | 6 |
| BNP Paribas, Paris | 720 | 7.075 | - | - | - | - |
| Brown Brothers Harriman & Co | 11.337 | 85.599 | 24.299 | 32.667 | 10.664 | 660 |
| Citibank, New York | - | - | 10.930.286 | 11.223.942 | - | - |
| DNB, Oslo | 4.233 | - | - | - | - | - |
| HSBC Bank Plc, Hong Kong | - | 15.786 | - | - | - | - |
| HSBC Bank Plc, London | - | - | - | - | 54 | - |
| JPMorgan Chase, New York | 737.217 | - | 72.364 | - | - | - |
| MUFG Bank, Tokyo | 6.259 | 21.208 | - | - | - | - |
| Nordea Bank, Oslo | 35 | 52 | - | - | - | - |
| Royal Bank of Canada, Toronto | - | 2.702.169 | - | 11.223.942 | - | 77.062 |
| Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm | 25.934 | 685 | - | - | - | 4 |
| Sumitomo, Tokyo | 78.733 | 1.562.643 | - | 11.223.942 | 5.251.653 | - |
| Insgesamt | 1.162.072 | 4.700.090 | 11.026.949 | 50.248.991 | 5.262.402 | 77.732 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

| | Global Flexible Credit Income | | Global High Yield SDG Engagement | | Global High Yield Sustainable Action* | |
|--|-------------------------------|-----------------------|----------------------------------|-----------------------|---------------------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| ANZ Bank, London | - | 681.475 | - | - | 1.059 | 915.917 |
| Bank of Montreal, London | - | - | - | - | 1.060 | - |
| Bank of Nova Scotia, Toronto | 792 | 744 | - | - | 1.060 | - |
| Barclays Bank, London | - | - | - | - | 220 | - |
| BBH, New York | - | - | - | - | 42.897 | - |
| BNP Paribas, Paris | - | - | 1.176 | - | - | - |
| Brown Brothers Harriman & Co | 53.406 | 45.556 | 48.339 | 20.691 | 222 | 1.253 |
| Citibank, New York | - | - | - | - | 1.060 | - |
| DNB, Oslo | - | - | - | - | 500 | - |
| HSBC Bank Plc, London | - | - | - | 1.146 | - | - |
| JPMorgan Chase, New York | - | 8.843.449 | - | 4.833.186 | 1.060 | - |
| Royal Bank of Canada, Toronto | - | - | - | - | 1.060 | - |
| Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm | 327.014 | - | 394.203 | - | 1.060 | 13.904 |
| Sumitomo, Tokyo | 25.100.882 | 547.637 | 10.265.487 | 404.491 | 1.060 | 102.147 |
| Insgesamt | 25.482.094 | 10.118.861 | 10.709.205 | 5.259.514 | 52.318 | 1.033.221 |

* Das Portfolio wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

| | Global Investment Grade Credit | | Global Opportunistic Bond | | Global Real Estate Securities | |
|--|--------------------------------|-----------------------|---------------------------|-----------------------|-------------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| ANZ Bank, Hong Kong | - | - | - | - | 5.841 | - |
| ANZ Bank, London | - | - | 15.142 | 1.160 | - | 9 |
| Bank of Nova Scotia, Toronto | 69 | 331.728 | 3.929 | 1.451 | 195 | 916 |
| BNP Paribas, Paris | - | - | 5.414 | 31.700 | 26 | - |
| Brown Brothers Harriman & Co | 12.902 | 5.658 | 214.704 | 114.657 | 1.744 | 3.184 |
| DNB, Oslo | - | - | 5.788 | - | 2.409 | - |
| HSBC Bank Plc, Hong Kong | - | - | - | - | - | 16.142 |
| HSBC Bank Plc, London | 1.198.923 | - | - | - | - | - |
| JPMorgan Chase, New York | - | - | - | 5.157.636 | - | 1.102.718 |
| MUFG Bank, Tokyo | - | - | 26.850 | - | - | - |
| Royal Bank of Canada, Toronto | 2.075.370 | 1.647.409 | - | - | - | - |
| Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm | - | - | 147.654 | 291.327 | 67 | - |
| Sumitomo, Tokyo | 114.199 | 1.580.436 | 1.109.973 | 265.332 | 201.367 | 2.272 |
| Insgesamt | 3.401.463 | 3.565.231 | 1.529.454 | 5.863.263 | 211.649 | 1.125.241 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

| | Global Sustainable Equity | | Global Sustainable Value | | | High Yield Bond | |
|--|---------------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|--|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | |
| | | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | |
| ANZ Bank, Hong Kong | - | - | 36 | - | - | - | |
| ANZ Bank, London | - | - | 26 | 1.176 | - | - | |
| Bank of Nova Scotia, Toronto | - | - | 1.931 | 1.980 | - | - | |
| Barclays Bank, London | 90 | - | - | - | - | 10.543.050 | |
| BBH, Grand Cayman | - | 5 | - | 120 | - | - | |
| BNP Paribas, Paris | 17 | - | 222 | 40 | - | - | |
| Brown Brothers Harriman & Co | 4.806 | 4.994 | 7.891 | 8.161 | 158.989 | 388.523 | |
| Citibank, London | - | - | - | - | - | 61.521 | |
| Citibank, New York | 775.000 | - | - | - | - | - | |
| Credit Suisse AG, Zurich | - | 6 | - | - | - | - | |
| DNB, Oslo | 85 | - | 2 | - | - | - | |
| HSBC Bank Plc, Hong Kong | - | - | - | 25 | - | - | |
| JPMorgan Chase, New York | - | 1.064.594 | - | - | 73.453.680 | 123.483.341 | |
| MUFG Bank, Tokyo | - | - | - | 3 | - | - | |
| Nordea Bank, Oslo | 946 | 945 | 100 | 18 | - | - | |
| Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm | - | 60 | 534.728 | - | - | - | |
| Sumitomo, Tokyo | 226 | 110 | - | 715.983 | 5.263 | - | |
| Insgesamt | 781.170 | 1.070.714 | 544.936 | 727.506 | 73.617.932 | 134.476.435 | |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

| | InnovAsia 5G | | Japan Equity Engagement | | Macro Opportunities FX | |
|--|-----------------------|-----------------------|-------------------------|-----------------------|------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | JPY | JPY | EUR | EUR |
| Bank of Montreal, London | - | - | - | - | 32.952 | - |
| Barclays Bank, London | - | - | - | - | 21 | - |
| BBH, Grand Cayman | - | 1 | - | - | - | - |
| BNP Paribas, Paris | 6 | - | - | - | - | - |
| Brown Brothers Harriman & Co | 10.719 | 2.479 | - | - | 242 | 141 |
| Citibank, New York | 1.118.218 | - | - | - | - | 912 |
| HSBC Bank Plc, Hong Kong | - | 4 | - | - | - | - |
| MUFG Bank, Tokyo | - | - | 90.965.141 | 421.921.338 | - | - |
| Royal Bank of Canada, Toronto | - | 593.850 | - | - | - | - |
| Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm | - | - | - | - | 93.660 | 20 |
| Sumitomo, Tokyo | - | 2 | - | - | - | 130.034 |
| Insgesamt | 1.128.943 | 596.336 | 90.965.141 | 421.921.338 | 126.875 | 131.107 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

| | Multi-Asset Income* | | Next Generation Mobility | | Next Generation Space Economy ² | |
|---|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|--|-------------------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 US\$ | Zum 31. Dezember 2022 US\$ | Zum 31. Dezember 2023 US\$ | Zum 31. Dezember 2022 US\$ | Zum 31. Dezember 2023 US\$ | Zum 31. Dezember 2022 US\$ |
| ANZ Bank, London | - | 27.772 | 2 | 9.687.021 | - | - |
| Bank of Nova Scotia, Toronto | - | 9 | 58.961 | - | - | - |
| BBH, Grand Cayman | - | 1 | - | - | - | 1 |
| BNP Paribas, Paris | - | 198 | - | - | 3 | - |
| Brown Brothers Harriman & Co | 58.916 | 25.216 | 44.850 | 30.352 | 2.565 | 1.598 |
| Canadian Imperial Bank of Commerce, Toronto | - | - | - | - | - | - |
| Citibank, New York | - | - | 11.585.167 | - | 940.668 | - |
| Credit Suisse AG, Zurich | - | 8 | - | - | - | - |
| DNB, Oslo | - | - | 9 | - | - | - |
| HSBC Bank Plc, Hong Kong | - | 466 | 12 | 9 | - | - |
| HSBC Bank Plc, London | - | - | - | - | 6 | - |
| JPMorgan Chase, New York | - | 663.587 | - | - | - | - |
| MUFG Bank, Tokyo | - | 46.385 | - | - | - | - |
| Nordea Bank, Oslo | - | 30 | - | - | - | - |
| Royal Bank of Canada, London | - | - | 57 | - | - | - |
| Royal Bank of Canada, Toronto | - | 436.998 | - | - | - | 553.649 |
| Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm | - | 84.600 | 2 | 1 | - | - |
| Sumitomo, Tokyo | - | 510.051 | - | - | 46 | 26 |
| Insgesamt | 58.916 | 1.795.321 | 11.689.060 | 9.717.383 | 943.288 | 555.274 |

² Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

* Das Portfolio wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

| | Responsible Asian Debt – Hard Currency | | Short Duration Emerging Market Debt | | Short Duration High Yield SDG Engagement | |
|--|--|-----------------------|-------------------------------------|-----------------------|--|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| ANZ Bank, London | - | - | - | 191 | - | - |
| Barclays Bank, London | - | - | - | - | 2.665.526 | - |
| BNP Paribas, Paris | - | - | - | - | 395 | 399 |
| Brown Brothers Harriman & Co | 85.097 | 6.508 | 76.426 | 447.514 | 151.589 | 84.117 |
| Citibank, New York | 2.623.771 | 1.173.705 | 9.105.400 | 158.792.223 | 41.651.733 | - |
| HSBC Bank Plc, Hong Kong | - | - | - | - | 3 | 5 |
| JPMorgan Chase, New York | - | - | - | - | - | 26.512.099 |
| MUFG Bank, Tokyo | - | - | 4 | - | 10 | - |
| Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm | - | - | - | - | - | 1.257.126 |
| Sumitomo, Tokyo | - | 48 | 5.076.125 | 37.315.688 | - | 12 |
| Insgesamt | 2.708.868 | 1.180.261 | 14.257.955 | 196.555.616 | 44.469.256 | 27.853.758 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

| | Strategic Income | | Sustainable Asia High Yield | | Sustainable Emerging Market Corporate Debt | |
|--|-----------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------------------|--|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| ANZ Bank, Hong Kong | 134 | - | - | - | - | - |
| ANZ Bank, London | - | 40 | - | - | - | - |
| Bank of Nova Scotia, Toronto | 51.500.431 | 340.990 | - | - | - | - |
| BNP Paribas, Paris | 1.815.812 | 1.835.401 | - | - | - | - |
| Brown Brothers Harriman & Co | 342.923 | 514.071 | 5.263 | 7.098 | 131.390 | 172.843 |
| Citibank, New York | - | 92.478.753 | 1.155.619 | - | - | - |
| DNB, Oslo | 41 | - | - | - | - | - |
| HSBC Bank Plc, Hong Kong | - | 25 | - | - | - | - |
| HSBC Bank Plc, London | 216.020 | - | - | - | - | - |
| JPMorgan Chase, New York | - | 6.265.751 | - | - | - | - |
| Nordea Bank, Oslo | 5.343 | 5.386 | - | - | - | - |
| Royal Bank of Canada, Toronto | - | - | - | 2.228.125 | - | 6.780.260 |
| Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm | - | - | - | - | 6 | - |
| Sumitomo, Tokyo | 1.324.930 | 3.538.083 | 2.195 | 534.967 | 3.844.875 | 6 |
| Insgesamt | 55.205.634 | 104.978.500 | 1.163.077 | 2.770.190 | 3.976.271 | 6.953.109 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

| | Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency ² | | Tactical Macro ¹ | | Ultra Short Term Euro Bond | |
|--|---|-----------------------|-----------------------------|-----------------------|----------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | EUR | EUR |
| Bank of Nova Scotia, Toronto | 4.604.889 | - | - | - | - | - |
| BNP Paribas, Paris | - | - | 148 | - | - | - |
| Brown Brothers Harriman & Co | 1.117 | 21.151 | 37.013 | - | 26.934 | 26.816 |
| Citibank, New York | - | - | 1.541.601 | - | 94.551 | - |
| JPMorgan Chase, New York | - | - | 1.893.496 | - | - | 93.584 |
| MUFG Bank, Tokyo | - | - | 753 | - | - | - |
| Nordea Bank, Oslo | - | - | 4 | - | - | - |
| Royal Bank of Canada, London | - | - | 43.619 | - | 11.093.807 | - |
| Royal Bank of Canada, Toronto | - | 8.131.270 | - | - | - | - |
| Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm | - | - | 37.666 | - | 7.280 | - |
| Sumitomo, Tokyo | 2.436.526 | 472.775 | - | - | - | 9.919.073 |
| Insgesamt | 7.042.532 | 8.625.196 | 3.554.300 | - | 11.222.572 | 10.039.473 |

¹ Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

² Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

| | Uncorrelated Strategies | | Uncorrelated Trading ^{2*} | | US Equity | |
|---|-------------------------------|-------------------------------|------------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 US\$ | Zum 31. Dezember 2022 US\$ | Zum 31. Dezember 2023 US\$ | Zum 31. Dezember 2022 US\$ | Zum 31. Dezember 2023 US\$ | Zum 31. Dezember 2022 US\$ |
| ANZ Bank, Hong Kong | 218.464 | - | - | - | - | - |
| ANZ Bank, London | 952.642 | 10.278.374 | - | 2.633.103 | - | - |
| Bank of Montreal, London | 8.552.039 | - | - | - | - | - |
| Bank of Nova Scotia, Toronto | 4.626.950 | 4.692.746 | - | 716.044 | - | - |
| Barclays Bank, London | 92.899 | 1.461 | - | - | - | - |
| BBH, Grand Cayman | - | 1.671 | - | 120 | - | - |
| BBH, New York | 92.993 | - | - | - | - | - |
| BNP Paribas, Paris | 3.060.417 | 1.551.615 | - | 3.110.791 | - | - |
| Brown Brothers Harriman & Co | 2.270.350 | 6.239.065 | 198.922 | 171.782 | 9.332 | 7.205 |
| Canadian Imperial Bank of Commerce, Toronto | - | - | - | - | - | - |
| Citibank, London | 2.621.204 | 7.014 | - | 1.636.196 | - | - |
| Citibank, New York | 92.203.361 | 29.580.967 | - | 4.245.695 | - | - |
| Credit Suisse AG, Zurich | - | 289.893 | - | 12.219 | - | - |
| DNB, Oslo | 4.926.275 | - | - | - | - | - |
| HSBC Bank Plc, Hong Kong | 1.359.612 | 425.640 | - | 2.290 | - | - |
| HSBC Bank Plc, London | 1.282.249 | 511 | - | 155.949 | - | - |
| JPMorgan Chase, New York | 40.362.701 | 122.010.499 | - | 4.125.371 | - | - |
| MUFG Bank, Tokyo | 110.182 | 11.879 | - | 175.896 | - | - |
| National Australia Bank, London | - | 2.399.742 | - | - | - | 191.583 |
| Nordea Bank, Oslo | 151.618 | 1.487 | - | 11 | - | - |
| Royal Bank of Canada, London | 618.592 | - | - | - | - | - |
| Royal Bank of Canada, Toronto | 15.475.809 | 59.244.394 | - | 31.631.227 | - | - |
| Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm | 11.432.447 | 8.513.551 | - | 2.585.640 | 2.307.738 | - |
| Sumitomo, Tokyo | 25.584.764 | 55.896.809 | - | 15.006.166 | - | 2.196.478 |
| Insgesamt | 215.995.568 | 301.147.318 | 198.922 | 66.208.500 | 2.317.070 | 2.395.266 |

² Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

* Das Portfolio wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

| | US Equity Index PutWrite | | US Large Cap Value | | US Long Short Equity | |
|--|--------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Bank of Montreal, London | - | - | - | - | 4.906.575 | - |
| BBH, New York | - | - | - | - | 1 | - |
| BNP Paribas, Paris | - | - | - | - | 14 | - |
| Brown Brothers Harriman & Co | 269.501 | 157.884 | 366.677 | 140.298 | 16.317 | 98.659 |
| Citibank, New York | - | - | 122.081.772 | - | - | - |
| Credit Suisse AG, Zurich | - | - | - | - | - | 11 |
| HSBC Bank Plc, Hong Kong | 147 | 141 | - | - | - | 2 |
| JPMorgan Chase, New York | - | - | - | - | - | 15.573.911 |
| Royal Bank of Canada, London | - | - | - | - | 3.995 | - |
| Royal Bank of Canada, Toronto | 4.824.800 | - | - | 75.057.821 | - | 3.197.677 |
| Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm | 3 | - | 7.038.957 | - | - | - |
| Sumitomo, Tokyo | 51.076.090 | 44.333.902 | 6 | 4 | - | 15.573.911 |
| Insgesamt | 56.170.541 | 44.491.927 | 129.487.412 | 75.198.123 | 4.926.902 | 34.444.171 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

| | US Multi Cap Opportunities | | US Real Estate Securities | | US Small Cap | |
|--|----------------------------|-----------------------|---------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| ANZ Bank, London | - | 4 | 847 | 821 | 3 | 26.133 |
| Bank of Montreal, London | - | - | 12.777.934 | - | - | - |
| Bank of Nova Scotia, Toronto | - | - | - | - | 13.163 | 12.365 |
| Barclays Bank, London | - | - | - | - | 28.653 | - |
| BBH, Grand Cayman | - | - | - | 1 | - | - |
| BNP Paribas, Paris | 5 | 5 | - | - | - | - |
| Brown Brothers Harriman & Co | 6.078 | 5.734 | 45.962 | 59.573 | 28.003 | 48.019 |
| Citibank, London | - | - | - | - | - | 2 |
| DNB, Oslo | 6 | - | - | - | - | - |
| HSBC Bank Plc, Hong Kong | 2 | 3 | - | - | - | - |
| Royal Bank of Canada, Toronto | 2.014.851 | 1.253.428 | - | 21.823.790 | - | 10.588.172 |
| Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm | - | - | 6 | - | 12.674.878 | - |
| Sumitomo, Tokyo | - | - | - | 5 | 3 | - |
| Insgesamt | 2.020.942 | 1.259.174 | 12.824.749 | 21.884.190 | 12.744.703 | 10.674.691 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

| | US Small Cap Intrinsic Value | |
|--|------------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ |
| Brown Brothers Harriman & Co | 92.397 | 31.273 |
| Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm | - | 8.808.823 |
| Sumitomo, Tokyo | 18.206.721 | - |
| Insgesamt | 18.299.118 | 8.840.096 |

Entsprechend den Leitlinien der Central Bank of Ireland mit dem Titel „Umbrella Funds – Cash Accounts Holding Subscription, Redemption and Dividend Monies“ (Kassenbestände mit Zeichnungs-, Rücknahme- und Ausschüttungsgeldern), die im März 2016 herausgegeben wurden, werden eines oder mehrere Konten für die Kassenbestände des Fonds in Übereinstimmung mit den Anforderungen der CBI von der Verwaltungsstelle im Auftrag des Fonds gehalten. Derlei Konten für Kassenbestände sind dazu gedacht, nicht abgewickelte Zeichnungsgelder von Anlegern, an Anleger zahlbare Rücknahmegelder und/oder sonstige an Anleger fällige Beträge zu halten. Zum 31. Dezember 2023 beliefen sich die Gelder in diesen Konten auf 331.887 US\$ (31. Dezember 2022: 1.424.081 US\$). Jegliche zum Ende des Geschäftsjahres auf diesen Barkonten gehaltenen Gelder werden in den Gesamtbilanzen des Fonds ausgewiesen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

4. KONTENÜBERZIEHUNG

Per 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 werden alle in der Bilanz ausgewiesenen Überziehungskredite bei Brown Brothers Harriman & Co. gehalten.

5. ANTEILKAPITAL

Das genehmigte Anteilkapital des Fonds beträgt 500.000.040.000 nennwertlose Anteile und besteht aus 40.000 Zeichneranteilen ohne Nennwert sowie 500.000.000.000 gewinnberechtigten Anteilen ohne Nennwert. Die Direktoren sind befugt, bis zu 500.000.000.000 nennwertlose Anteile des Fonds zu den von ihnen für geeignet erachteten Konditionen auszugeben.

Der Fonds ist aufgrund seiner Fähigkeit, Anteile auf Aufforderung auszugeben und zurückzunehmen, eine Investmentgesellschaft mit variablem Kapital. Das Anteilkapital des Fonds ist in verschiedene Anteilsserien aufgeteilt, wobei jede Anteilsserie ein separates Investmentportfolio mit Vermögenswerten darstellt. Die Portfolios verwalten Kapital in Übereinstimmung mit den OGAW-Vorschriften und den Anlagezielen und der Anlagepolitik, die für solch ein Portfolio gelten und im vorliegenden Prospekt und jeweiligen Nachtrag des Portfolios festgelegt sind. Die Portfolios unterliegen keinen extern vorgeschriebenen Kapitalerfordernissen. Während die Portfolios in übertragbare Wertpapiere und andere liquide Finanzanlagen investieren, verfolgt der Manager auch einen angemessenen Prozess zur Überwachung des Liquiditätsrisikos, der die von den Portfolios eingesetzten Transaktionen für ein effizientes Portfoliomanagement berücksichtigt, um sicherzustellen, dass jedes Portfolio in der Lage ist, die angegebenen Bedingungen bei Anteilsrücknahmen zu erfüllen.

Um potenzielle Liquiditätsrisiken zu mindern, passt der Manager seine Kontrollen an die verschiedenen Anlagestrategien, Liquiditätsbedingungen und das Kundenverhalten in der Vergangenheit an. Als Teil der Risikoüberwachung kann der Manager auf verschiedene Liquiditätstests zurückgreifen, deren Ergebnisse zahlreiche Lösungen bedingen können, darunter eine Anpassung der Zusammensetzung der Vermögenswerte, die Inanspruchnahme von Überziehungs- oder Kreditfazilitäten oder anderer geeignete Maßnahmen, um ein hinlängliches Liquiditätsniveau sicherzustellen. Alle Vereinbarungen auf Portfolioebene werden von der Risikofunktion des Managers, den Portfoliomanagern des betreffenden Portfolios, dem Chief Investment Officer des Managers sowie den Direktoren des Managers und den Direktoren der Gesellschaft überprüft. Das Risikoteam des Managers führt regelmäßig Portfoliostresstests im Kontext der Zusammensetzung des jeweiligen Portfolios und der aktuellen/potenziellen Marktbedingungen durch. Dabei werden Stressszenarien mit verschiedenen hypothetischen Rücknahmeniveaus durchgespielt und die Fähigkeit der Portfolios bewertet, Rücknahmeanträge auf diesen Niveaus auf ordnungsgemäße Weise zu erfüllen. Sollte die Analyse ergeben, dass eines der Portfolios eine niedrige Liquiditätsdeckungsquote aufweist, werden Rücksprachen seitens des Risikoteams des Managers und des Portfolioteams gehalten und relevante Schritte unternommen, um die damit verbundenen Risiken zu bewerten und auf bestmögliche Weise zu verringern. Ferner werden auf Tagesbasis die Liquiditätspuffer im Rahmen der Berichterstattung überwacht, um das Liquiditätsrisiko eines jeden Portfolios zu erfassen. Abgesehen davon werden die Marktliquidität betreffende Faktoren überwacht, um diesbezügliche potenzielle Anomalien zu erfassen.

Am 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 waren 2 Zeichneranteile ausgegeben. Die Zeichneranteile berechtigen die Inhaber zur Teilnahme und Abstimmung auf Hauptversammlungen des Fonds, berechtigen die Inhaber jedoch nicht am Gewinn oder am Vermögen des Fonds zu partizipieren, mit Ausnahme einer Kapitalrückzahlung im Falle einer Liquidation. Die gewinnberechtigten Anteile ermächtigen die Inhaber zur Teilnahme und Stimmabgabe bei Hauptversammlungen des Fonds sowie zur Beteiligung an den Gewinnen und den Vermögenswerten des Fonds.

Die Zeichneranteile werden wie folgt gehalten:

| Name des Anteilinhabers | Anzahl der Anteile |
|---------------------------------|---------------------------|
| Matsack Nominees Limited | 1 |
| Neuberger Berman Europe Limited | 1 |

Die Mindestzeichnungs- und Rücknahmegrenzen für jeden Teilfonds finden sich im Verkaufsprospekt des Fonds.

Das Kapital der Portfolios wird durch das auf die Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteilen entfallende Nettovermögen repräsentiert. Der Betrag des den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens kann sich auf Monatsbasis erheblich ändern, da die Portfolios monatlichen Zeichnungen und Rücknahmen nach Ermessen der Anteilinhaber unterliegen.

Die Ziele der Portfolios für die Verwaltung des Kapitals sind:

- Das Kapital in Anlagen zu investieren, die den Anlagezielen, den Anlagepolitiken, dem Risiko und der erwarteten Rendite gemäß den Angaben im Verkaufsprospekt entsprechen;
- Erzielung von Renditen bei gleichzeitigem Kapitalschutz durch Anwendung der im Verkaufsprospekt angegebenen Anlagestrategien;
- Aufrechterhaltung einer ausreichenden Liquidität zur Begleichung der Ausgaben der Portfolios und um Rücknahmeanträge zu erfüllen, wenn sie entstehen; und
- Aufrechterhaltung einer ausreichenden Größe, um den Betrieb der Portfolios kosteneffizient zu gestalten.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Veränderung der Anzahl rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile im Geschäftsjahr:

5G Connectivity

| | Thesaurierende Klasse AUD A | Thesaurierende Klasse AUD I2* | Thesaurierende Klasse CHF A* | Thesaurierende Klasse CHF I* | Thesaurierende Klasse CHF I2* | Thesaurierende Klasse CNY A | Thesaurierende Klasse CNY I2* | Thesaurierende Klasse EUR A | Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungs- gesichert) | Thesaurierende Klasse EUR I |
|--|--------------------------------|----------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|----------------------------------|--------------------------------|----------------------------------|--------------------------------|---|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 2.137.146 | – | – | – | – | 41.590 | – | 5.175.148 | 5.791.246 | 5.085.224 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 600.388 | 4.665 | 2.627 | 2.627 | 2.675 | – | 2.181 | 408.666 | 1.393.678 | 1.016.506 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (806.919) | – | – | – | – | (11.993) | – | (1.642.840) | (2.839.506) | (2.276.778) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 1.930.615 | 4.665 | 2.627 | 2.627 | 2.675 | 29.597 | 2.181 | 3.940.974 | 4.345.418 | 3.824.952 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 2.604.463 | – | – | – | – | 52.732 | – | 7.433.954 | 6.167.163 | 5.429.505 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 71.103 | – | – | – | – | – | – | 764.409 | 3.177.781 | 2.057.988 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (538.420) | – | – | – | – | (11.142) | – | (3.023.215) | (3.553.698) | (2.402.269) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 2.137.146 | – | – | – | – | 41.590 | – | 5.175.148 | 5.791.246 | 5.085.224 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

5G Connectivity (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungs- gesichert) | Thesaurierende Klasse EUR I2* | Thesaurierende Klasse EUR I5 | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungs- gesichert) | Thesaurierende Klasse GBP A | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungs- gesichert) | Thesaurierende Klasse GBP I2* | Thesaurierende Klasse HKD A | Thesaurierende Klasse HKD I2* | Thesaurierende Klasse SGD A |
|--|---|----------------------------------|---------------------------------|---|--------------------------------|---|----------------------------------|--------------------------------|----------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 4.835.463 | – | 194.128 | 4.899.354 | 1.222.283 | 68.522 | – | 5.414.373 | – | 2.280.615 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 1.290.694 | 2.791 | – | 543.853 | 107.886 | 2.304 | 2.400 | 2.836.065 | 23.473 | 38.815 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (2.496.221) | – | (192.163) | (634.221) | (535.509) | (42.084) | – | (4.179.386) | – | (544.973) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 3.629.936 | 2.791 | 1.965 | 4.808.986 | 794.660 | 28.742 | 2.400 | 4.071.052 | 23.473 | 1.774.457 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 7.941.448 | – | 311.788 | 4.539.162 | 1.492.479 | 82.730 | – | 8.536.035 | – | 2.909.801 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 2.180.308 | – | – | 862.513 | 39.345 | – | – | 234.576 | – | 79.507 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (5.286.293) | – | (117.660) | (502.321) | (309.541) | (14.208) | – | (3.356.238) | – | (708.693) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 4.835.463 | – | 194.128 | 4.899.354 | 1.222.283 | 68.522 | – | 5.414.373 | – | 2.280.615 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

5G Connectivity (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse SGD I2* | Thesaurierende Klasse USD A | Thesaurierende Klasse USD E* | Thesaurierende Klasse USD I | Ausschüttende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD I2 | Thesaurierende Klasse USD I3 | Thesaurierende Klasse USD I5 | Thesaurierende Klasse USD M | Thesaurierende Klasse USD Z |
|--|----------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | – | 46.228.556 | – | 14.717.531 | 1.931.717 | 995.963 | 9.735.467 | 1.246.071 | 2.923.879 | 112.195 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 2.039 | 1.600.865 | 232.269 | 662.756 | 34.656 | 97.633 | 475.669 | – | 115.513 | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | (13.005.639) | (167.419) | (6.132.703) | (428.955) | (995.963) | (1.277.082) | (64.764) | (736.239) | (3.771) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 2.039 | 34.823.782 | 64.850 | 9.247.584 | 1.537.418 | 97.633 | 8.934.054 | 1.181.307 | 2.303.153 | 108.424 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | – | 61.777.605 | – | 24.758.164 | 3.120.952 | 995.963 | 10.641.211 | 2.514.302 | 3.526.969 | 87.653 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | 2.756.481 | – | 2.837.113 | 178.355 | – | 792.941 | 100.134 | 247.437 | 26.079 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | (18.305.530) | – | (12.877.746) | (1.367.590) | – | (1.698.685) | (1.368.365) | (850.527) | (1.537) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | – | 46.228.556 | – | 14.717.531 | 1.931.717 | 995.963 | 9.735.467 | 1.246.071 | 2.923.879 | 112.195 |

| | Thesaurierende Klasse ZAR A* | Thesaurierende Klasse ZAR E* |
|--|---------------------------------|---------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | – | – |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 52.912 | 26.304 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (23.617) | (9.889) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 29.295 | 16.415 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

China A-Share Equity

| | Thesaurierende Klasse USD I | Ausschüttende Klasse USD I | |
|--|--|--------------------------------|--------------------------------|
| | Thesaurierende (nicht währungs- Klasse CNY I gesichert) | (nicht währungs- gesichert) | (nicht währungs- gesichert) |
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 1.461 | 2.934 | 250.091 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | – | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | – | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 1.461 | 2.934 | 250.091 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 1.461 | 44.290 | 250.091 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | 1.934 | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | (43.290) | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 1.461 | 2.934 | 250.091 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

China Bond

| | Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse CNY I | Thesaurierende Klasse CNY Z | Thesaurierende Klasse EUR I* | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungs- gesichert)* | Thesaurierende Klasse GBP I2 | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) (nicht währungs- gesichert) | Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungs- gesichert) | Thesaurierende Klasse USD Z | Thesaurierende Klasse USD Z (nicht währungs- gesichert) |
|--|--|-------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|--|---------------------------------|---|---|--------------------------------|---|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 1.993 | 2.348 | 1.832 | – | – | 2.176 | 68.293 | 563.515 | 4.953.693 | 1.215.396 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | – | – | – | – | – | 10.621 | 10 | – | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | – | – | – | – | – | (27.567) | (272.976) | (134.890) | (7.087) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 1.993 | 2.348 | 1.832 | – | – | 2.176 | 51.347 | 290.549 | 4.818.803 | 1.208.309 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 1.993 | 14.415 | 1.832 | 8.000 | 55.985 | 4.467 | 195.760 | 1.807.436 | 5.179.582 | 1.219.964 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | 2.347 | – | – | – | – | 548.099 | – | – | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | (14.414) | – | (8.000) | (55.985) | (2.291) | (675.566) | (1.243.921) | (225.889) | (4.568) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 1.993 | 2.348 | 1.832 | – | – | 2.176 | 68.293 | 563.515 | 4.953.693 | 1.215.396 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

China Equity

| | Thesaurierende Klasse CHF I | Thesaurierende Klasse EUR A | Thesaurierende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR Z | Ausschüttende Klasse GBP A | Ausschüttende Klasse GBP I2 (nicht währungs- gesichert)* | Thesaurierende Klasse SGD A | Thesaurierende Klasse USD A | Ausschüttende Klasse USD A | Thesaurierende Klasse USD I |
|--|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|--|--------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 29.100 | 69.274 | 53.783 | 891 | 1.265 | – | 72.240 | 1.123.752 | 49.808 | 8.620.770 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | – | – | – | 5 | – | – | – | – | 113 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (11.000) | (15.241) | (3.666) | – | – | – | (7.777) | (285.858) | (1.250) | (3.067.712) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 18.100 | 54.033 | 50.117 | 891 | 1.270 | – | 64.463 | 837.894 | 48.558 | 5.553.171 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 29.100 | 91.322 | 59.292 | 891 | 16.265 | 9.629 | 82.932 | 1.511.178 | 80.016 | 10.238.115 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | – | 5.565 | – | – | – | – | – | – | 173 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | (22.048) | (11.074) | – | (15.000) | (9.629) | (10.692) | (387.426) | (30.208) | (1.617.518) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 29.100 | 69.274 | 53.783 | 891 | 1.265 | – | 72.240 | 1.123.752 | 49.808 | 8.620.770 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

China Equity (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD I2 | Thesaurierende Klasse USD M | Thesaurierende Klasse USD U | Thesaurierende Klasse USD Z |
|--|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 882.670 | 1.356 | 1.464.746 | 16.176 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 984.661 | – | – | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (304.835) | – | (333.260) | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 1.562.496 | 1.356 | 1.131.486 | 16.176 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 981.572 | 2.273.337 | 1.745.160 | 16.176 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | – | – | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (98.902) | (2.271.981) | (280.414) | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 882.670 | 1.356 | 1.464.746 | 16.176 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Climate Innovation¹

| | Thesaurierende Klasse USD A* | Thesaurierende Klasse USD I* | Thesaurierende Klasse USD I5* | Thesaurierende Klasse USD Z* |
|--|---------------------------------|---------------------------------|----------------------------------|---------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | – | – | – | – |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 1.000 | 1.000 | 1.000 | 300.000 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | – | – | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 1.000 | 1.000 | 1.000 | 300.000 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

CLO Income

| | Thesaurierende Klasse EUR A* | Thesaurierende Klasse EUR I | Ausschüttende Klasse EUR I2 | Ausschüttende Klasse GBP I2* | Ausschüttende Klasse GBP I5* | Thesaurierende Klasse GBP Z | Thesaurierende Klasse SEK I | Thesaurierende Klasse USD A* | Thesaurierende Klasse USD I | Ausschüttende Klasse USD I* |
|--|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 6.454 | 1.114.755 | 1.593.672 | 2.711.194 | – | 4.854 | 279.735 | 6.339 | 1.278.134 | – |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | 1.552.035 | 482.891 | 3.123 | – | – | – | 937 | 3.511.722 | 251.228 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (3.630) | (76.687) | (878.268) | (2.714.317) | – | – | (35.671) | (3.732) | (462.335) | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 2.824 | 2.590.103 | 1.198.295 | – | – | 4.854 | 244.064 | 3.544 | 4.327.521 | 251.228 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | – | 180.581 | 1.527.618 | 3.291.633 | 2.780 | 7.139 | 308.215 | – | 1.553.808 | – |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 6.454 | 1.065.824 | 99.074 | 18.444 | – | – | – | 6.339 | 652.959 | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | (131.650) | (33.020) | (598.883) | (2.780) | (2.285) | (28.480) | – | (928.633) | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 6.454 | 1.114.755 | 1.593.672 | 2.711.194 | – | 4.854 | 279.735 | 6.339 | 1.278.134 | – |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

CLO Income (Fortsetzung)

| | Ausschüttende Klasse USD I2 | Ausschüttende Klasse USD I5 | Thesaurierende Klasse USD Z |
|--|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 3.310.195 | 4.382.421 | 42.619 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 1.293.641 | 423.722 | 9.365 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (387.440) | (1.460.411) | (817) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 4.216.396 | 3.345.732 | 51.167 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 2.478.474 | 4.117.440 | 42.619 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 831.721 | 264.981 | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | – | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 3.310.195 | 4.382.421 | 42.619 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Commodities²

| | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungs- gesichert)* | Thesaurierende Klasse GBP I5* | Thesaurierende Klasse USD A* | Thesaurierende Klasse USD I* | Thesaurierende Klasse USD I5* | Thesaurierende Klasse USD M* | Thesaurierende Klasse USD Z* |
|--|--|----------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|----------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 806 | 1.725.093 | 300.455 | 41.114 | 6.131.791 | 48.584 | 234.681 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 4.674.061 | 2.389.727 | 16.070 | 170.210 | 912.952 | – | 11.719 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (86.476) | (670.077) | (189.824) | (44.686) | (974.952) | (2.326) | (17.300) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 4.588.391 | 3.444.743 | 126.701 | 166.638 | 6.069.791 | 46.258 | 229.100 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | – | – | – | – | – | – | – |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 806 | 2.057.623 | 322.881 | 553.882 | 6.833.789 | 62.411 | 250.306 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | (332.530) | (22.426) | (512.768) | (701.998) | (13.827) | (15.625) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 806 | 1.725.093 | 300.455 | 41.114 | 6.131.791 | 48.584 | 234.681 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond

| | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | Thesaurierende Klasse CHF P | Ausschüttende Klasse CHF P | Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) | Thesaurierende Klasse EUR A | Thesaurierende Klasse EUR I | Ausschüttende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR I2 | Ausschüttende Klasse EUR I2 | Thesaurierende Klasse EUR I3 |
|--|--|--------------------------------|-------------------------------|--|--------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 611.478 | 2.376.179 | 175.980 | 4.852.015 | 12.011.204 | 59.251.810 | 10.344.724 | 18.775.751 | 21.723.355 | 696.618 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 51.225 | 74.865 | 16.077 | 495.060 | 3.923.047 | 33.509.401 | 9.941.754 | 7.714.386 | 1.339.335 | 35.760 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (27.467) | (1.985.477) | (10.953) | (486.251) | (2.452.059) | (20.698.470) | (3.515.018) | (3.078.340) | (16.682.411) | (328.156) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 635.236 | 465.567 | 181.104 | 4.860.824 | 13.482.192 | 72.062.741 | 16.771.460 | 23.411.797 | 6.380.279 | 404.222 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 972.918 | 4.846.082 | 270.761 | 5.082.911 | 14.953.377 | 51.923.840 | 9.516.581 | 25.053.140 | 18.068.754 | 800.660 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | 231.156 | 24.861 | 531.196 | 2.164.517 | 36.312.718 | 8.439.193 | 3.323.164 | 6.804.679 | 177.517 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (361.440) | (2.701.059) | (119.642) | (762.092) | (5.106.690) | (28.984.748) | (7.611.050) | (9.600.553) | (3.150.078) | (281.559) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 611.478 | 2.376.179 | 175.980 | 4.852.015 | 12.011.204 | 59.251.810 | 10.344.724 | 18.775.751 | 21.723.355 | 696.618 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse EUR I5 | Thesaurierende Klasse EUR M | Ausschüttende Klasse EUR M | Thesaurierende Klasse EUR P | Ausschüttende Klasse EUR P | Thesaurierende Klasse GBP I | Thesaurierende Klasse GBP I2 | Ausschüttende Klasse GBP I2 | Thesaurierende Klasse GBP P | Ausschüttende Klasse GBP P |
|--|---------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 16.332.716 | 1.064.639 | 467.056 | 3.826.066 | 503.225 | 516.297 | 944.439 | 44.753 | 638.477 | 846.035 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 59.423 | 254.592 | 97.607 | 113.944 | 1.670.754 | 48.015 | 7.783 | 87 | 73.518 | 154.561 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (7.219.454) | (363.707) | (136.377) | (3.091.825) | (127.960) | (366.879) | (799.114) | (42.336) | (565.831) | (260.860) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 9.172.685 | 955.524 | 428.286 | 848.185 | 2.046.019 | 197.433 | 153.108 | 2.504 | 146.164 | 739.736 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 8.067.969 | 956.414 | 566.440 | 15.072.977 | 913.586 | 622.213 | 5.491.683 | 207.127 | 736.727 | 527.896 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 8.264.747 | 446.153 | 54.740 | 1.312.924 | 37.109 | 204.270 | 1.269.412 | 37.591 | 449.772 | 711.946 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | (337.928) | (154.124) | (12.559.835) | (447.470) | (310.186) | (5.816.656) | (199.965) | (548.022) | (393.807) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 16.332.716 | 1.064.639 | 467.056 | 3.826.066 | 503.225 | 516.297 | 944.439 | 44.753 | 638.477 | 846.035 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

| | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | Thesaurierende Klasse USD A | Ausschüttende Klasse USD A | Thesaurierende Klasse USD C1 | Thesaurierende Klasse USD I | Ausschüttende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD I2 | Ausschüttende Klasse USD I2 | Thesaurierende Klasse USD M |
|--|--|--|--------------------------------|-------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 87.891 | 6.691.421 | 4.384.732 | 7.910 | 611.702 | 4.388.388 | 166.429 | 582.240 | 525.564 | 826.171 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 19.551 | 428.125 | 665.491 | – | – | 1.071.125 | 7.892 | 41.876 | – | 54.287 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (356) | (1.320.177) | (1.024.003) | – | (286.051) | (1.973.285) | (65.494) | (158.024) | (26.140) | (191.931) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 107.086 | 5.799.369 | 4.026.220 | 7.910 | 325.651 | 3.486.228 | 108.827 | 466.092 | 499.424 | 688.527 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 125.739 | 9.233.259 | 5.532.404 | 7.910 | 859.901 | 15.782.837 | 131.085 | 6.481.087 | 124.890 | 1.056.212 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 394 | 378.686 | 540.681 | – | – | 2.299.939 | 35.344 | 18.993 | 546.581 | 21.690 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (38.242) | (2.920.524) | (1.688.353) | – | (248.199) | (13.694.388) | – | (5.917.840) | (145.907) | (251.731) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 87.891 | 6.691.421 | 4.384.732 | 7.910 | 611.702 | 4.388.388 | 166.429 | 582.240 | 525.564 | 826.171 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

| | Ausschüttende Klasse USD M | Thesaurierende Klasse USD P | Thesaurierende Klasse USD Z |
|--|-------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 269.098 | 1.406.289 | 33.730 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 24.175 | 36.223 | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (55.336) | (808.013) | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 237.937 | 634.499 | 33.730 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 300.463 | 5.415.895 | 16.723 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 8.128 | 538.232 | 17.007 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (39.493) | (4.547.838) | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 269.098 | 1.406.289 | 33.730 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Developed Market FMP – 2027¹

| | Thesaurierende Klasse EUR A* | Ausschüttende Klasse EUR I* | Thesaurierende Klasse USD A* | Ausschüttende Klasse USD A* | Thesaurierende Klasse USD I* | Ausschüttende Klasse USD I* | Thesaurierende Klasse USD X* | Ausschüttende Klasse USD X* |
|--|---------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | – | – | – | – | – | – | – | – |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 67.923 | 29.700 | 6.693.273 | 2.841.848 | 94.000 | 208.269 | 3.753.888 | 200.000 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | – | – | (243.116) | – | – | (300.903) | (115.958) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 67.923 | 29.700 | 6.693.273 | 2.598.732 | 94.000 | 208.269 | 3.452.985 | 84.042 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency

| | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse AUD I | Thesaurierende Klasse CAD I3 (nicht währungs- gesichert)* | Thesaurierende Klasse CHF I2 | Thesaurierende Klasse CHF P | Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) | Thesaurierende Klasse EUR A | Thesaurierende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungs- gesichert) | Ausschüttende Klasse EUR I |
|--|--|-------------------------------|---|---------------------------------|--------------------------------|--|--------------------------------|--------------------------------|---|-------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 310.297 | 2.773.139 | 4.300.000 | 20.893.906 | 2.782.320 | 1.188.410 | 3.418.120 | 11.499.248 | 1.959.764 | 27.569.346 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 47.366 | 3.831.153 | – | 1.897.886 | 463.983 | 204.834 | 1.810.788 | 1.950.853 | 312.490 | 2.152.511 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (82.980) | (3.812.069) | – | (6.907.986) | (269.424) | (187.540) | (369.886) | (5.641.539) | (496.993) | (4.177.367) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 274.683 | 2.792.223 | 4.300.000 | 15.883.806 | 2.976.879 | 1.205.704 | 4.859.022 | 7.808.562 | 1.775.261 | 25.544.490 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 336.608 | 3.044.734 | – | 5.175.988 | 3.624.178 | 1.268.188 | 2.537.540 | 26.528.625 | 111.663 | 30.832.656 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 10.636 | 279.725 | 4.300.000 | 22.773.581 | 601.730 | 97.218 | 2.441.751 | 3.451.354 | 2.474.758 | 2.396.628 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (36.947) | (551.320) | – | (7.055.663) | (1.443.588) | (176.996) | (1.561.171) | (18.480.731) | (626.657) | (5.659.938) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 310.297 | 2.773.139 | 4.300.000 | 20.893.906 | 2.782.320 | 1.188.410 | 3.418.120 | 11.499.248 | 1.959.764 | 27.569.346 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse EUR I2 | | Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungs-Ausschüttende gesichert)* | | Thesaurierende Klasse EUR I4 | | Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungs-Ausschüttende gesichert)* | | Thesaurierende Klasse EUR M | | Thesaurierende Klasse EUR P | | Thesaurierende Klasse EUR Z | |
|--|------------------------------|-----------|--|-------------|------------------------------|--------------|--|----------|-----------------------------|-------------|-----------------------------|---|-----------------------------|--------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 7.800.989 | 4.735.609 | 11.460.021 | 3.314.347 | – | 10.690.026 | 6.860.859 | 69.876 | 22.186 | 1.210.699 | – | – | – | 36.061 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 3.942.146 | 278.590 | 5.492.556 | – | – | 4.194.833 | 6.067.456 | – | 2 | 70.412 | – | – | – | 23.444 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (6.519.570) | (78.118) | (9.946.888) | (3.314.347) | – | (10.917.044) | (4.799.159) | (16.250) | (343) | (102.826) | – | – | – | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 5.223.565 | 4.936.081 | 7.005.689 | – | – | 3.967.815 | 8.129.156 | 53.626 | 21.845 | 1.178.285 | – | – | – | 59.505 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 10.113.936 | 4.323.512 | 9.873.905 | 3.857.277 | 281.619 | 13.665.964 | – | 76.470 | 27.801 | 4.228.081 | – | – | – | 36.061 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 3.344.344 | 525.000 | 6.856.961 | 760.000 | – | 1.172.856 | 9.378.359 | – | 2 | 557.075 | – | – | – | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (5.657.291) | (112.903) | (5.270.845) | (1.302.930) | (281.619) | (4.148.794) | (2.517.500) | (6.594) | (5.617) | (3.574.457) | – | – | – | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 7.800.989 | 4.735.609 | 11.460.021 | 3.314.347 | – | 10.690.026 | 6.860.859 | 69.876 | 22.186 | 1.210.699 | – | – | – | 36.061 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse GBP I | Ausschüttende Klasse GBP I | Thesaurierende Klasse GBP I2 | Ausschüttende Klasse GBP I2 | Thesaurierende Klasse GBP P | Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) | Thesaurierende Klasse JPY I | Thesaurierende Klasse SEK A | Thesaurierende Klasse SEK I (nicht währungs- gesichert)* | Thesaurierende Klasse SEK I2 |
|--|--------------------------------|-------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--|--------------------------------|--------------------------------|--|---------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 1.714.081 | 269.731 | 3.773.875 | 1.643.379 | 881.407 | 170.604 | 2.000.000 | 12.436.581 | – | 1.745.948 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 688.135 | 39.346 | 2.737.197 | 1.447.188 | 315.611 | 91.300 | – | 3.347.211 | – | 1.593.887 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (1.074.473) | (167.964) | (1.024.895) | (1.209.170) | (546.685) | (62.907) | – | (9.605.852) | – | (2.565.382) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 1.327.743 | 141.113 | 5.486.177 | 1.881.397 | 650.333 | 198.997 | 2.000.000 | 6.177.940 | – | 774.453 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 2.029.895 | 865.850 | 3.585.859 | 1.896.188 | 602.152 | 234.729 | 2.000.000 | 8.669.815 | 2.990 | 2.672.239 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 460.640 | 43.533 | 1.275.053 | 110.509 | 351.785 | 31.995 | – | 7.443.000 | – | 1.377.284 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (776.454) | (639.652) | (1.087.037) | (363.318) | (72.530) | (96.120) | – | (3.676.234) | (2.990) | (2.303.575) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 1.714.081 | 269.731 | 3.773.875 | 1.643.379 | 881.407 | 170.604 | 2.000.000 | 12.436.581 | – | 1.745.948 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

| | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | Thesaurierende Klasse USD A | Ausschüttende Klasse USD A | Thesaurierende Klasse USD C1 | Thesaurierende Klasse USD I | Ausschüttende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD I2 | Ausschüttende Klasse USD I2 | Ausschüttende Klasse USD I3 |
|--|--|--|--------------------------------|-------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 1.211.426 | 21.006.868 | 9.982.109 | 5.499 | 1.198.416 | 48.424.011 | 10.480.066 | 3.229.040 | 1.755.587 | 10.702.171 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 927.916 | 8.540.687 | 2.088.892 | 39.610 | – | 15.910.168 | 254.203 | 25.524.047 | 2.423.190 | 115.144 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (744.820) | (10.328.267) | (2.584.869) | – | (147.068) | (22.656.741) | (1.907.569) | (5.822.348) | (1.760.452) | (62.418) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 1.394.522 | 19.219.288 | 9.486.132 | 45.109 | 1.051.348 | 41.677.438 | 8.826.700 | 22.930.739 | 2.418.325 | 10.754.897 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 1.262.462 | 30.136.140 | 12.003.717 | 2.430 | 1.421.409 | 57.055.486 | 15.142.161 | 14.157.129 | 2.892.812 | 10.470.561 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 188.711 | 8.143.098 | 1.664.679 | 7.392 | – | 22.235.525 | 733.266 | 1.009.450 | 591.308 | 594.440 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (239.747) | (17.272.370) | (3.686.287) | (4.323) | (222.993) | (30.867.000) | (5.395.361) | (11.937.539) | (1.728.533) | (362.830) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 1.211.426 | 21.006.868 | 9.982.109 | 5.499 | 1.198.416 | 48.424.011 | 10.480.066 | 3.229.040 | 1.755.587 | 10.702.171 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD M | Ausschüttende Klasse USD M | Thesaurierende Klasse USD P | Thesaurierende Klasse USD X | Thesaurierende Klasse USD Z |
|--|--------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 1.893.262 | 486.711 | 1.966.497 | 12.069.574 | 9.753 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 206.826 | 76.873 | 4.914.966 | – | 250 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (353.278) | (26.849) | (794.797) | – | (250) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 1.746.810 | 536.735 | 6.086.666 | 12.069.574 | 9.753 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 2.202.670 | 491.168 | 2.774.160 | 2.500.000 | 820.791 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 332.572 | 32.117 | 432.042 | 9.569.574 | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (641.980) | (36.574) | (1.239.705) | – | (811.038) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 1.893.262 | 486.711 | 1.966.497 | 12.069.574 | 9.753 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency

| | Ausschüttende Klasse AUD B Thesaurierende (Monatlich) Klasse AUD B | Ausschüttende Klasse AUD C2 Thesaurierende (Monatlich)* Klasse AUD C2 | Ausschüttende Klasse AUD E Thesaurierende (Monatlich) Klasse AUD E | Ausschüttende Klasse AUD T Thesaurierende (Monatlich) Klasse AUD T | Thesaurierende Klasse EUR A | Thesaurierende Klasse EUR I | | | | |
|--|--|---|--|--|--------------------------------|--------------------------------|-------------|----------|-------------|-------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 1.011.815 | 36.723 | 19.109 | 1.035 | 113.572 | 5.703 | 7.223.444 | 266.766 | 416.611 | 1.814.361 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 157.199 | 13.139 | – | 925 | 95.750 | 6.521 | 873.320 | 12.401 | 251.037 | 2.675.328 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (689.985) | (15.218) | (19.109) | (1.034) | (64.554) | (3.961) | (1.316.251) | (42.817) | (392.961) | (1.020.709) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 479.029 | 34.644 | – | 926 | 144.768 | 8.263 | 6.780.513 | 236.350 | 274.687 | 3.468.980 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 2.874.215 | 60.489 | 72.201 | 15.252 | 427.610 | 7.478 | 7.062.666 | 267.908 | 3.348.101 | 3.668.913 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 32.920 | 23.258 | – | – | 19.711 | 316 | 1.939.354 | 49.791 | 437.240 | 16.598 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (1.895.320) | (47.024) | (53.092) | (14.217) | (333.749) | (2.091) | (1.778.576) | (50.933) | (3.368.730) | (1.871.150) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 1.011.815 | 36.723 | 19.109 | 1.035 | 113.572 | 5.703 | 7.223.444 | 266.766 | 416.611 | 1.814.361 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungs- gesichert) | Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungs- gesichert) | Ausschüttende Klasse EUR I3 (nicht währungs- gesichert)* | Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungs- gesichert) | Ausschüttende Klasse EUR M (nicht währungs- gesichert)* | Thesaurierende Klasse EUR Y (nicht währungs- gesichert) | Thesaurierende Klasse GBP I | Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungs- gesichert) | Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungs- gesichert) | Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungs- gesichert) |
|--|---|--|--|---|---|---|--------------------------------|--|---|---|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 16.617.422 | 1.203.690 | – | 2.575.012 | – | 8.570.577 | 9.350 | 5.761.938 | 4.826.229 | 5.545.152 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 613.431 | 88.000 | – | – | – | 262.605 | 35.152 | 3.670.139 | 3.177.866 | 299.059 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (1.370.365) | – | – | – | – | (1.086.932) | (1.395) | (1.752.548) | (2.556.466) | (2.122.014) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 15.860.488 | 1.291.690 | – | 2.575.012 | – | 7.746.250 | 43.107 | 7.679.529 | 5.447.629 | 3.722.197 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 19.419.261 | 3.066.056 | 1.155.703 | 2.575.012 | 33.468 | 9.831.973 | 8.914 | 9.362.787 | 10.591.181 | 12.369.887 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 2.030.549 | – | 22.447 | – | 622 | 313.175 | 436 | 76.647 | 1.936.702 | 1.795.578 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (4.832.388) | (1.862.366) | (1.178.150) | – | (34.090) | (1.574.571) | – | (3.677.496) | (7.701.654) | (8.620.313) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 16.617.422 | 1.203.690 | – | 2.575.012 | – | 8.570.577 | 9.350 | 5.761.938 | 4.826.229 | 5.545.152 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse SEK A | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | Thesaurierende Klasse USD A | Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) | Thesaurierende Klasse USD B | Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich) | Thesaurierende Klasse USD C2* | Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) | Thesaurierende Klasse USD E |
|--|--------------------------------|--|--|--------------------------------|--|--------------------------------|---|----------------------------------|--|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 102.692 | 40.442 | 584.118 | 1.720.702 | 2.987.299 | 69.674 | 131.749 | 2.864 | 827.707 | 39.193 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 26.432 | 72.846 | 224.429 | 155.635 | 2.535.938 | 128.492 | – | – | 544.831 | 37.046 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (43.921) | (48.388) | (39.200) | (331.387) | (2.677.045) | (140.224) | (130.847) | (2.864) | (937.401) | (47.188) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 85.203 | 64.900 | 769.347 | 1.544.950 | 2.846.192 | 57.942 | 902 | – | 435.137 | 29.051 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 111.944 | 48.992 | 1.068.304 | 2.052.642 | 7.146.348 | 270.658 | 363.914 | 10.263 | 1.579.392 | 83.939 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 7.096 | 4.798 | 11.784 | 426.493 | 1.236.935 | 23.550 | 38.562 | – | 140.879 | 2.985 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (16.348) | (13.348) | (495.970) | (758.433) | (5.395.984) | (224.534) | (270.727) | (7.399) | (892.564) | (47.731) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 102.692 | 40.442 | 584.118 | 1.720.702 | 2.987.299 | 69.674 | 131.749 | 2.864 | 827.707 | 39.193 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

| | Ausschüttende Klasse USD I Thesaurierende | | | | | Ausschüttende Klasse USD T Thesaurierende | | | | | Ausschüttende Klasse ZAR B |
|--|--|--------------|--------------|---------------|---------------|--|--------------|--------------|--------------|-------------|-------------------------------|
| | (Monatlich) | Klasse USD I | Klasse USD I | Klasse USD I2 | Klasse USD I5 | (Monatlich) | Klasse USD T | Klasse USD X | Klasse USD Y | (Monatlich) | |
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 5.289.657 | 44.694.639 | 77.414 | 6.703.311 | 2 | 11.229.883 | 472.178 | 17.117.475 | 19.204.022 | 3.381.337 | |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 419.314 | 6.030.817 | 90.800 | 2.144.542 | 1.579 | 2.428.036 | 105.832 | – | 314.212 | 627.026 | |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (1.176.000) | (30.311.291) | (11.200) | (1.233.348) | – | (2.168.217) | (127.810) | (2.091.973) | (2.266.092) | (2.746.974) | |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 4.532.971 | 20.414.165 | 157.014 | 7.614.505 | 1.581 | 11.489.702 | 450.200 | 15.025.502 | 17.252.142 | 1.261.389 | |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 7.668.272 | 49.154.691 | 1.949.580 | 9.446.506 | 2 | 10.232.675 | 364.727 | 16.751.294 | 20.191.331 | 7.756.959 | |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 192.560 | 3.700.133 | 73.206 | 1.151.195 | – | 4.245.889 | 223.077 | 803.818 | 2.769.806 | 777.350 | |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (2.571.175) | (8.160.185) | (1.945.372) | (3.894.390) | – | (3.248.681) | (115.626) | (437.637) | (3.757.115) | (5.152.972) | |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 5.289.657 | 44.694.639 | 77.414 | 6.703.311 | 2 | 11.229.883 | 472.178 | 17.117.475 | 19.204.022 | 3.381.337 | |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse ZAR B | Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich) | Thesaurierende Klasse ZAR C2 | Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) | Thesaurierende Klasse ZAR E | Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) | Thesaurierende Klasse ZAR T |
|--|--------------------------------|---|---------------------------------|--|--------------------------------|--|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 61.413 | 79.825 | 918 | 565.614 | 7.324 | 13.901.287 | 350.741 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 82.750 | 2.171 | 1.596 | 286.872 | 39.298 | 2.870.617 | 54.777 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (49.494) | (80.131) | (918) | (462.017) | (44.807) | (2.675.598) | (41.044) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 94.669 | 1.865 | 1.596 | 390.469 | 1.815 | 14.096.306 | 364.474 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 167.621 | 271.158 | 19.288 | 1.819.795 | 31.946 | 12.509.758 | 270.673 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 3.576 | 1.324 | – | 1.066.419 | 3.607 | 4.980.625 | 146.137 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (109.784) | (192.657) | (18.370) | (2.320.600) | (28.229) | (3.589.096) | (66.069) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 61.413 | 79.825 | 918 | 565.614 | 7.324 | 13.901.287 | 350.741 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend

| | Ausschüttende Klasse AUD I3 | Thesaurierende Klasse EUR A | Thesaurierende Klasse EUR I | Ausschüttende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR I2 | Ausschüttende Klasse EUR I2 | Ausschüttende Klasse EUR I3 | Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungs- gesichert) | Thesaurierende Klasse EUR I5 | Thesaurierende Klasse EUR M |
|--|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--|---------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 1.104.926 | 1.087.375 | 20.867.944 | 3.568.511 | 1.904.679 | 1.433.425 | 3.000 | 59.066 | 1.963.354 | 53.295 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 39.376 | 154.942 | 2.618.624 | 342.925 | 34.771 | 168.899 | 4.738.000 | 121.106 | 104.206 | 6.388 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (129.541) | (204.956) | (1.324.356) | (732.826) | (692.964) | (368.248) | – | – | (303.883) | (7.461) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 1.014.761 | 1.037.361 | 22.162.212 | 3.178.610 | 1.246.486 | 1.234.076 | 4.741.000 | 180.172 | 1.763.677 | 52.222 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 838.742 | 735.712 | 25.576.646 | 4.799.433 | 3.429.534 | 2.352.885 | 3.000 | 50.811 | 2.300.297 | 64.193 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 266.184 | 622.266 | 4.500.693 | 757.995 | 205.500 | 86.385 | – | 8.255 | 143.294 | 4.701 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | (270.603) | (9.209.395) | (1.988.917) | (1.730.355) | (1.005.845) | – | – | (480.237) | (15.599) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 1.104.926 | 1.087.375 | 20.867.944 | 3.568.511 | 1.904.679 | 1.433.425 | 3.000 | 59.066 | 1.963.354 | 53.295 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

| | Ausschüttende Klasse EUR M | Thesaurierende Klasse EUR Z | Thesaurierende Klasse GBP I | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungs- gesichert) | Ausschüttende Klasse GBP I | Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungs- gesichert) | Thesaurierende Klasse GBP P | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungs- gesichert) | Thesaurierende Klasse GBP Z | Thesaurierende Klasse NOK U |
|--|-------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|---|-------------------------------|--|--------------------------------|---|--------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 39.883 | 9.487 | 32.887 | 539 | 1.454.417 | 66.844 | 723.194 | 97.670 | 16.888 | 2.285 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 141.769 | 4.348 | 19.482 | – | 183.622 | 29.269 | 73.965 | 2.017 | – | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (7.233) | (750) | (13.704) | (2) | (427.890) | (28.665) | (490.449) | (11.028) | – | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 174.419 | 13.085 | 38.665 | 537 | 1.210.149 | 67.448 | 306.710 | 88.659 | 16.888 | 2.285 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 68.909 | 9.487 | 47.813 | 7.969.618 | 2.129.774 | 67.660 | 6.702.498 | 120.606 | 16.888 | 2.285 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 5.848 | – | 6.070 | 9.497 | 485.624 | 5.957 | 1.598.832 | 32.606 | – | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (34.874) | – | (20.996) | (7.978.576) | (1.160.981) | (6.773) | (7.578.136) | (55.542) | – | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 39.883 | 9.487 | 32.887 | 539 | 1.454.417 | 66.844 | 723.194 | 97.670 | 16.888 | 2.285 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse SEK A | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | Thesaurierende Klasse USD A | Thesaurierende Klasse USD C1 | Thesaurierende Klasse USD I | Ausschüttende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD I2* | Ausschüttende Klasse USD I2 | Thesaurierende Klasse USD I3* |
|--|--------------------------------|--|--|--------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|----------------------------------|--------------------------------|----------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 265.050 | 327.916 | 54.657 | 981.528 | 128.728 | 2.807.500 | 54.262 | – | 5.530.120 | 4.576.696 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 152.562 | 7.429 | 2.385 | 13.304 | – | 449.658 | – | – | 586.697 | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (180.647) | (5.350) | (6.668) | (419.509) | (37.676) | (1.737.939) | (8.236) | – | (701.271) | (4.576.696) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 236.965 | 329.995 | 50.374 | 575.323 | 91.052 | 1.519.219 | 46.026 | – | 5.415.546 | – |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 255.617 | 331.074 | 53.122 | 1.077.163 | 138.851 | 8.302.920 | 183.411 | 857 | 6.511.508 | 4.576.696 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 240.910 | 583 | 1.535 | 121.202 | – | 582.689 | – | – | 334.979 | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (231.477) | (3.741) | – | (216.837) | (10.123) | (6.078.109) | (129.149) | (857) | (1.316.367) | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 265.050 | 327.916 | 54.657 | 981.528 | 128.728 | 2.807.500 | 54.262 | – | 5.530.120 | 4.576.696 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD I5* | Thesaurierende Klasse USD M | Ausschüttende Klasse USD Me | Thesaurierend Klasse USD Z |
|--|----------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | – | 88.987 | 81.894 | 9.459 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 3.262.906 | – | 23.358 | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | (9.187) | (10.743) | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 3.262.906 | 79.800 | 94.509 | 9.459 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | – | 117.705 | 73.585 | 10.645 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | – | 16.799 | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | (28.718) | (8.490) | (1.186) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | – | 88.987 | 81.894 | 9.459 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

| | Thesaurierende Klasse AUD I2 | Thesaurierende Klasse NOK I | Thesaurierende Klasse NOK I3* | Thesaurierende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD I2 | Thesaurierende Klasse USD Z |
|--|---------------------------------|--------------------------------|----------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 2.533.722 | 2.885.428 | – | 3.680 | 470.000 | 492.314 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | 1.792.862 | 3.694.799 | – | – | 212.458 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | (4.649.563) | (14.316) | – | – | (94.684) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 2.533.722 | 28.727 | 3.680.483 | 3.680 | 470.000 | 610.088 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 2.533.722 | 1.297.729 | – | 253.797 | 470.000 | 348.996 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | 2.051.255 | – | – | – | 250.358 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | (463.556) | – | (250.117) | – | (107.040) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 2.533.722 | 2.885.428 | – | 3.680 | 470.000 | 492.314 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Equity

| | Thesaurierende Klasse AUD B | Thesaurierende Klasse AUD C2 | Thesaurierende Klasse AUD E | Thesaurierende Klasse AUD T | Ausschüttende Klasse CAD I (nicht währungs- gesichert) | Ausschüttende Klasse CAD I2 | Thesaurierende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR M | Thesaurierende Klasse EUR Z | Thesaurierende Klasse GBP I |
|--|--------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 42.721 | 1.253 | 13.736 | 179.662 | 8.285 | 1.492.500 | 158.403 | 43.504 | 22.279 | 39.061 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 4.713 | 1.575 | – | 17.318 | – | – | 18.826 | 1.105 | – | 970 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (18.174) | (1.253) | (9.219) | (21.706) | – | – | (98.758) | (4.485) | – | (1.047) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 29.260 | 1.575 | 4.517 | 175.274 | 8.285 | 1.492.500 | 78.471 | 40.124 | 22.279 | 38.984 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 77.425 | 6.917 | 11.885 | 187.792 | 10.285 | 1.492.500 | 381.451 | 46.687 | 22.279 | 38.853 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 17.986 | 409 | 3.069 | 34.641 | – | – | 61.061 | 2.364 | – | 11.671 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (52.690) | (6.073) | (1.218) | (42.771) | (2.000) | – | (284.109) | (5.547) | – | (11.463) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 42.721 | 1.253 | 13.736 | 179.662 | 8.285 | 1.492.500 | 158.403 | 43.504 | 22.279 | 39.061 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse GBP Z | Thesaurierende Klasse JPY I* | Thesaurierende Klasse USD A | Thesaurierende Klasse USD B | Thesaurierende Klasse USD C2 | Thesaurierende Klasse USD E | Thesaurierende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD M | Thesaurierende Klasse USD T | Thesaurierende Klasse USD Z |
|--|--------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 6.841 | – | 510.968 | 142.250 | 12.018 | 26.692 | 14.554.442 | 37.562 | 354.357 | 1.020.891 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | – | 49.332 | 147.850 | 8.954 | 132.366 | 2.460.892 | 56.218 | 3.658.770 | 1.313.056 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | – | (40.321) | (208.672) | (20.005) | (145.899) | (13.374.360) | (54.541) | (3.660.850) | (330.781) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 6.841 | – | 519.979 | 81.428 | 967 | 13.159 | 3.640.974 | 39.239 | 352.277 | 2.003.166 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 17.841 | 1.174.407 | 476.703 | 328.832 | 33.145 | 19.471 | 15.399.570 | 6.185.010 | 356.194 | 1.709.914 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | – | 117.946 | 103.942 | 4.188 | 28.447 | 2.982.466 | 25.478 | 2.728.820 | 410.041 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (11.000) | (1.174.407) | (83.681) | (290.524) | (25.315) | (21.226) | (3.827.594) | (6.172.926) | (2.730.657) | (1.099.064) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 6.841 | – | 510.968 | 142.250 | 12.018 | 26.692 | 14.554.442 | 37.562 | 354.357 | 1.020.891 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse ZAR B | Thesaurierende Klasse ZAR C2 | Thesaurierende Klasse ZAR E | Thesaurierende Klasse ZAR T |
|--|--------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 51.412 | 9.331 | 32.536 | 186.675 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 36.066 | 179 | 11.109 | 43.286 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (49.709) | (9.148) | (14.649) | (59.970) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 37.769 | 362 | 28.996 | 169.991 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 90.926 | 20.376 | 44.151 | 164.928 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 67.137 | 275 | – | 72.365 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (106.651) | (11.320) | (11.615) | (50.618) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 51.412 | 9.331 | 32.536 | 186.675 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Select Equity**

| | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungs- gesichert)* | Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungs- gesichert)* | Thesaurierende Klasse USD I* | Ausschüttende Klasse USD I* | Thesaurierende Klasse USD I5* |
|--|---|---|---------------------------------|--------------------------------|----------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 230.967 | 1.141.036 | 9.264.115 | – | 8.000 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 89.745 | – | 6.235 | – | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (320.712) | (1.141.036) | (9.270.350) | – | (8.000) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | – | – | – | – | – |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 316.974 | 1.143.998 | 9.194.294 | 2.882 | 15.950 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 182.949 | – | 83.094 | – | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (268.956) | (2.962) | (13.273) | (2.882) | (7.950) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 230.967 | 1.141.036 | 9.264.115 | – | 8.000 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

** Das Portfolio wurde am 7. September 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Euro Bond

| | Thesaurierende Klasse EUR I | Ausschüttende Klasse EUR I |
|--|--------------------------------|-------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 7.902 | 978.926 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 51.761 | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 59.663 | 978.926 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 3.000 | 978.926 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 4.902 | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 7.902 | 978.926 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Euro Bond Absolute Return

| | Thesaurierende Klasse EUR I | Ausschüttende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR I5 | Thesaurierende Klasse USD Z |
|--|--------------------------------|-------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 215.032 | 930 | 1.768.586 | 2.708.212 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 3.788 | – | 60.992 | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (129.142) | – | (1.345.703) | (185.000) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 89.678 | 930 | 483.875 | 2.523.212 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 387.980 | 1.377.486 | 2.016.235 | 1.314.758 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 38.756 | 930 | 639.539 | 1.393.454 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (211.704) | (1.377.486) | (887.188) | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 215.032 | 930 | 1.768.586 | 2.708.212 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

European High Yield Bond

| | Thesaurierende Klasse CHF I* | Thesaurierende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR I2* | Thesaurierende Klasse EUR I5* | Thesaurierende Klasse EUR M | Thesaurierende Klasse EUR X | Thesaurierende Klasse EUR Y* | Ausschüttende Klasse EUR Y | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)* | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) |
|--|---------------------------------|--------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|-------------------------------|---|--|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | – | 70.978 | – | – | 46.402 | 484.244 | – | – | – | 39.764 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 169.131 | 3.345.324 | 19.772 | 599.602 | 39.741 | 3.578.268 | 25.017.638 | 273.800 | – | 10.696 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (2.011) | (46.667) | – | – | (23.437) | (94.523) | (105.006) | – | – | (11.536) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 167.120 | 3.369.635 | 19.772 | 599.602 | 62.706 | 3.967.989 | 24.912.632 | 273.800 | – | 38.924 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | – | 59.014 | – | – | 37.016 | 479.831 | – | – | 3.481 | 160.081 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | 12.718 | – | – | 10.250 | 4.413 | – | – | 6.750 | 5.332 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | (754) | – | – | (864) | – | – | – | (10.231) | (125.649) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | – | 70.978 | – | – | 46.402 | 484.244 | – | – | – | 39.764 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

European High Yield Bond (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD X | Thesaurierende Klasse USD Z |
|--|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 16.131 | 222.524 | 2.161.439 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | 38.512 | 626.959 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (2.276) | (218.884) | (1.300.133) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 13.855 | 42.152 | 1.488.265 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 1.043.739 | 631.554 | 861.306 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 299 | – | 1.300.133 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (1.027.907) | (409.030) | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 16.131 | 222.524 | 2.161.439 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

European Sustainable Equity

| | Ausschüttende Klasse EUR A* | Thesaurierende Klasse EUR I | Ausschüttende Klasse EUR I | Ausschüttende Klasse EUR I3 | Thesaurierende Klasse EUR I5 | Thesaurierende Klasse EUR M | Thesaurierende Klasse EUR Z | Thesaurierende Klasse USD A (nicht währungs- gesichert) | Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungs- gesichert) | Thesaurierende Klasse USD M (nicht währungs- gesichert) |
|--|--------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|---|---|---|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 2.627 | 3.190 | 1.027 | 16.220.988 | 212.473 | 2.396 | 3.569.643 | 1.000 | 1.971.793 | 1.000 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 1.090 | – | – | 1.308.425 | 24.661 | 1.825 | 1.647.905 | – | – | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (1.090) | – | – | (5.271.427) | (17.898) | (384) | (450) | – | (1.970.793) | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 2.627 | 3.190 | 1.027 | 12.257.986 | 219.236 | 3.837 | 5.217.098 | 1.000 | 1.000 | 1.000 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | – | 2.992 | 3.544.179 | 4.652.561 | 200.000 | 2.396 | 26.561 | 1.000 | 1.971.793 | 1.000 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 2.627 | 1.315 | 1.027 | 14.308.101 | 12.633 | – | 3.543.082 | – | – | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | (1.117) | (3.544.179) | (2.739.674) | (160) | – | – | – | – | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 2.627 | 3.190 | 1.027 | 16.220.988 | 212.473 | 2.396 | 3.569.643 | 1.000 | 1.971.793 | 1.000 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Event Driven²

| | Thesaurierende Klasse EUR I* | Thesaurierende Klasse GBP I5* | Ausschüttende Klasse GBP I5* | Thesaurierende Klasse GBP P* | Thesaurierende Klasse USD I* | Thesaurierende Klasse USD I5* |
|--|---------------------------------|----------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|----------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | – | 2.369.000 | 2.584 | 2.584 | 1.001.000 | 242.352 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 39.011 | 5.976.587 | 1.354.344 | – | – | 1.198.538 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (38.088) | (1.123.229) | (207.394) | – | (1.000.000) | (136.293) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 923 | 7.222.358 | 1.149.534 | 2.584 | 1.000 | 1.304.597 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | – | – | – | – | – | – |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | 2.369.000 | 2.584 | 2.584 | 1.001.000 | 242.352 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | – | – | – | – | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | – | 2.369.000 | 2.584 | 2.584 | 1.001.000 | 242.352 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global Bond

| | Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) | Thesaurierende Klasse EUR I Benchmark Währungs- gesicherte Klasse* | Thesaurierende Klasse USD C1 | Thesaurierende Klasse USD I Benchmark Währungs- gesicherte Klasse* | Thesaurierende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD M | Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) | Thesaurierende Klasse USD Z | Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) |
|--|--|---|---------------------------------|---|--------------------------------|--------------------------------|--|--------------------------------|--|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 3.937 | – | 48.437 | 3.000 | 148.271 | 28.428 | 3.000 | 13.134.827 | 4.481 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | 2.766 | – | – | 468.227 | 56.948 | – | 688.840 | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | – | (10.696) | – | (303.317) | (41.294) | – | (4.118.948) | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 3.937 | 2.766 | 37.741 | 3.000 | 313.181 | 44.082 | 3.000 | 9.704.719 | 4.481 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 3.937 | – | 62.811 | – | 148.271 | 71.273 | 3.000 | 14.839.075 | 4.481 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | – | – | 3.000 | – | – | – | 1.420.929 | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | – | (14.374) | – | – | (42.845) | – | (3.125.177) | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 3.937 | – | 48.437 | 3.000 | 148.271 | 28.428 | 3.000 | 13.134.827 | 4.481 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global Diversified Income FMP – 2024

| | Thesaurierende Klasse EUR A | Ausschüttende Klasse EUR A | Ausschüttende Klasse EUR I | Ausschüttende Klasse GBP I | Ausschüttende Klasse HKD A | Ausschüttende Klasse SGD A | Thesaurierende Klasse USD A | Ausschüttende Klasse USD A | Thesaurierende Klasse USD I | Ausschüttende Klasse USD I |
|--|--------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 122.227 | 25.000 | 100.000 | 214.842 | 750.000 | 262.720 | 2.950.200 | 4.579.424 | 253.567 | 224.117 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | – | – | – | – | – | – | 3.995 | – | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | – | – | (9.843) | – | (25.000) | (359.672) | (556.942) | – | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 122.227 | 25.000 | 100.000 | 204.999 | 750.000 | 237.720 | 2.590.528 | 4.026.477 | 253.567 | 224.117 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 122.227 | 25.000 | 100.000 | 214.842 | 750.000 | 272.720 | 3.387.413 | 5.097.571 | 379.967 | 243.821 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | – | – | – | – | – | – | 2.181 | – | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | – | – | – | – | (10.000) | (437.213) | (520.328) | (126.400) | (19.704) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 122.227 | 25.000 | 100.000 | 214.842 | 750.000 | 262.720 | 2.950.200 | 4.579.424 | 253.567 | 224.117 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global Diversified Income FMP – 2024 (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD X | Ausschüttende Klasse USD X |
|--|--------------------------------|-------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 2.104.508 | 5.781.902 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 2.104.508 | 5.781.902 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 2.104.508 | 10.781.902 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | (5.000.000) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 2.104.508 | 5.781.902 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global Equity Megatrends

| | Thesaurierende Klasse EUR I* | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungs- gesichert) | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungs- gesichert)* | Thesaurierende Klasse SGD A* | Thesaurierende Klasse USD A | Thesaurierende Klasse USD C1 | Thesaurierende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD M | Thesaurierende Klasse USD Z* |
|--|---------------------------------|---|--|---------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | – | 392.901 | – | – | 2.717.651 | 302.253 | 747.642 | 1.482.972 | 1.012.699 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 757.848 | 152.789 | 786 | 2.010 | 1.009.129 | – | 2.092.148 | 488.858 | 1.098.322 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (1.817) | (57.962) | – | – | (835.553) | (44.835) | (640.872) | (450.992) | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 756.031 | 487.728 | 786 | 2.010 | 2.891.227 | 257.418 | 2.198.918 | 1.520.838 | 2.111.021 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | – | 183.655 | – | – | 2.297.293 | 304.508 | 1.309.925 | 1.605.824 | – |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | 242.316 | – | – | 999.209 | – | 387.698 | 287.778 | 1.347.320 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | (33.070) | – | – | (578.851) | (2.255) | (949.981) | (410.630) | (334.621) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | – | 392.901 | – | – | 2.717.651 | 302.253 | 747.642 | 1.482.972 | 1.012.699 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global Flexible Credit Income

| | Thesaurierende Klasse CAD I5 | Thesaurierende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR M | Thesaurierende Klasse GBP I5 | Thesaurierende Klasse USD A | Thesaurierende Klasse USD I | Ausschüttende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD M | Thesaurierende Klasse USD Z |
|--|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 1.500.000 | 376.242 | 42.202 | 18.706.078 | 937.398 | 11.735.927 | 34.986 | 580.784 | 485.090 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | 399.091 | 8.248 | 1.524.684 | 166.296 | 2.115.137 | – | 85.523 | 10.704 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (103.413) | (369.708) | (6.106) | (7.313.951) | (188.671) | (540.234) | – | (62.015) | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 1.396.587 | 405.625 | 44.344 | 12.916.811 | 915.023 | 13.310.830 | 34.986 | 604.292 | 495.794 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 1.500.000 | 299.356 | 38.595 | 33.076.878 | 982.153 | 11.653.437 | 38.979 | 571.721 | 930.894 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | 107.508 | 9.471 | 6.974.366 | 245.888 | 192.595 | – | 128.463 | 14.178 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | (30.622) | (5.864) | (21.345.166) | (290.643) | (110.105) | (3.993) | (119.400) | (459.982) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 1.500.000 | 376.242 | 42.202 | 18.706.078 | 937.398 | 11.735.927 | 34.986 | 580.784 | 485.090 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global High Yield SDG Engagement

| | Ausschüttende Klasse AUD I* | Thesaurierende Klasse CHF I4* | Ausschüttende Klasse CHF I4* | Thesaurierende Klasse CHF X* | Thesaurierende Klasse EUR I4* | Ausschüttende Klasse EUR I4* | Thesaurierende Klasse EUR X* | Thesaurierende Klasse EUR Z (PF) | Thesaurierende Klasse GBP I4* | Thesaurierende Klasse GBP X* |
|--|--------------------------------|----------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|----------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|--|----------------------------------|---------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 4.223 | 3.658.671 | 226.381 | 2.931 | 3.611.348 | 96.247 | 2.846 | 2.044.067 | 833.380 | 2.398 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | 4.875.169 | 343.161 | – | 4.502.144 | 55.133 | – | 255.131 | 1.182.689 | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | (1.133.029) | (57.140) | – | (1.858.016) | (35.704) | – | (233.436) | (300.995) | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 4.223 | 7.400.811 | 512.402 | 2.931 | 6.255.476 | 115.676 | 2.846 | 2.065.762 | 1.715.074 | 2.398 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | – | – | – | – | – | – | – | 1.967.593 | – | – |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 4.223 | 5.993.488 | 339.523 | 2.931 | 6.256.908 | 141.559 | 2.846 | 239.186 | 1.449.844 | 2.398 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | (2.334.817) | (113.142) | – | (2.645.560) | (45.312) | – | (162.712) | (616.464) | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 4.223 | 3.658.671 | 226.381 | 2.931 | 3.611.348 | 96.247 | 2.846 | 2.044.067 | 833.380 | 2.398 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD A | Thesaurierende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD I4* | Ausschüttende Klasse USD M | Thesaurierende Klasse USD X | Thesaurierende Klasse USD Z |
|--|--------------------------------|--------------------------------|----------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 53.218 | 6.992 | 22.306.996 | 157.097 | 2.013 | 657.453 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | 414.155 | 11.989.848 | 3.718 | – | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (3.000) | (6.175) | (3.981.033) | (2.863) | – | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 50.218 | 414.972 | 30.315.811 | 157.952 | 2.013 | 657.453 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 68.756 | 9.572 | – | 230.509 | 1.000 | 656.664 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 995 | 816 | 27.180.169 | 83.387 | 1.013 | 789 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (16.533) | (3.396) | (4.873.173) | (156.799) | – | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 53.218 | 6.992 | 22.306.996 | 157.097 | 2.013 | 657.453 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global High Yield Sustainable Action**

| | Thesaurierende Klasse USD I* | Ausschüttende Klasse USD I* | Thesaurierende Klasse USD X* | Thesaurierende Klasse USD Y* |
|--|---------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 1.000 | 1.458.132 | 1.000 | 300.000 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | – | – | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (1.000) | (1.458.132) | (1.000) | (300.000) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | – | – | – | – |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 1.000 | 1.458.132 | 1.000 | 300.000 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | – | – | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | – | – | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 1.000 | 1.458.132 | 1.000 | 300.000 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

** Das Portfolio wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global Investment Grade Credit

| | Thesaurierende Klasse EUR I* | Thesaurierende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD X | Thesaurierende Klasse USD Z |
|--|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | – | 145.058 | 5.002.702 | 4.998.000 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 2.730 | 51.487 | – | 535 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | (4.340) | (668.585) | (200.000) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 2.730 | 192.205 | 4.334.117 | 4.798.535 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | – | 1.000 | 5.001.417 | 4.998.000 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | 144.058 | 1.285 | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | – | – | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | – | 145.058 | 5.002.702 | 4.998.000 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global Opportunistic Bond

| | Thesaurierende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse GBP P | Thesaurierende Klasse USD A | Thesaurierende Klasse USD I | Ausschüttende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD I2 | Thesaurierende Klasse USD M* | Thesaurierende Klasse USD Z |
|--|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 967.405 | 2.295 | 47.120 | 379.169 | 942.090 | 2.391.648 | – | 2.868.980 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 1.530 | – | 853 | 23.993 | 309.278 | 22.772 | – | 84.231 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (967.405) | – | (46.046) | (10.193) | – | (291.069) | – | (595.978) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 1.530 | 2.295 | 1.927 | 392.969 | 1.251.368 | 2.123.351 | – | 2.357.233 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 454.585 | 2.295 | 65.944 | 1.059.158 | 942.090 | 2.269.235 | 83.656 | 3.312.736 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 512.820 | – | 190 | 379.017 | – | 395.349 | 1.935 | 803.213 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | – | (19.014) | (1.059.006) | – | (272.936) | (85.591) | (1.246.969) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 967.405 | 2.295 | 47.120 | 379.169 | 942.090 | 2.391.648 | – | 2.868.980 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global Real Estate Securities

| | Ausschüttende Klasse EUR I5* | Thesaurierende Klasse EUR M | Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungs- gesichert) | Thesaurierende Klasse GBP Z | Thesaurierende Klasse USD A | Thesaurierende Klasse USD CI | Thesaurierende Klasse USD I | Ausschüttende Klasse USD I5 | Thesaurierende Klasse USD M | Thesaurierende Klasse USD Z |
|--|---------------------------------|--------------------------------|---|--------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 1.173.704 | 103.501 | 9.210 | 7.307 | 437.183 | 14.639 | 1.323.134 | 320.057 | 74.771 | 277.113 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 146.514 | 7.341 | 9.234 | – | 28.812 | – | 97.887 | – | 2.817 | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (1.320.218) | (24.530) | (300) | – | (136.094) | – | (506.106) | (316.742) | (2.022) | (103.001) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | – | 86.312 | 18.144 | 7.307 | 329.901 | 14.639 | 914.915 | 3.315 | 75.566 | 174.112 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 809.283 | 100.679 | 8.510 | 7.007 | 492.609 | 17.770 | 1.204.954 | 320.057 | 160.948 | 357.656 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 421.681 | 14.038 | 700 | 300 | 129.425 | 4.042 | 880.811 | – | 18.490 | 178.571 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (57.260) | (11.216) | – | – | (184.851) | (7.173) | (762.631) | – | (104.667) | (259.114) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 1.173.704 | 103.501 | 9.210 | 7.307 | 437.183 | 14.639 | 1.323.134 | 320.057 | 74.771 | 277.113 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global Sustainable Equity

| | Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungs- gesichert) | Ausschüttende Klasse EUR I5 (nicht währungs- gesichert)* | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungs- gesichert) | Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungs- gesichert) | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungs- gesichert) | Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungs- gesichert) | Thesaurierende Klasse USD A | Thesaurierende Klasse USD I | Ausschüttende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD M | Thesaurierende Klasse USD Z* |
|--|--|--|---|---|---|--|--------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 7.828.939 | – | 6.081 | 124.615 | 53.508 | 404.831 | 71.933 | 1.202.620 | 1.131 | 42.328 | 3.468.551 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 859.111 | – | 852 | 664 | 53.464 | 99.618 | 18.698 | 310.136 | – | – | 286.772 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (1.510.479) | – | – | (2.455) | (21.886) | (123.076) | (37.758) | (490.317) | – | (2.110) | (89.560) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 7.177.571 | – | 6.933 | 122.824 | 85.086 | 381.373 | 52.873 | 1.022.439 | 1.131 | 40.218 | 3.665.763 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 8.434.035 | – | 5.048 | 126.953 | 722 | 723 | 3.877 | 1.951.221 | 2.830.918 | 1.378.094 | – |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 5.670.939 | 128.325 | 1.122 | 2.689 | 55.858 | 487.376 | 70.294 | 667.682 | 1.131 | 36.447 | 4.323.346 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (6.276.035) | (128.325) | (89) | (5.027) | (3.072) | (83.268) | (2.238) | (1.416.283) | (2.830.918) | (1.372.213) | (854.795) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 7.828.939 | – | 6.081 | 124.615 | 53.508 | 404.831 | 71.933 | 1.202.620 | 1.131 | 42.328 | 3.468.551 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global Sustainable Value

| | Thesaurierende Klasse EUR M | Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungs- gesichert)* | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungs- gesichert)* | Thesaurierende Klasse USD A | Thesaurierende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD I3* | Thesaurierende Klasse USD Z |
|--|--------------------------------|---|--|--------------------------------|--------------------------------|----------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 34.497 | 927 | – | 132.262 | 178.944 | 2.442.209 | 1.062.770 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 4.179 | – | 823 | 31.243 | 441.693 | 580.185 | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (5.658) | – | – | (87.879) | (83.211) | (219.433) | (499.410) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 33.018 | 927 | 823 | 75.626 | 537.426 | 2.802.961 | 563.360 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 37.248 | – | – | 62.071 | 15.459 | – | 903.522 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 3.074 | 927 | – | 127.259 | 1.883.989 | 2.515.374 | 801.702 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (5.825) | – | – | (57.068) | (1.720.504) | (73.165) | (642.454) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 34.497 | 927 | – | 132.262 | 178.944 | 2.442.209 | 1.062.770 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

High Yield Bond

| | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | Thesaurierende Klasse AUD A | Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) | Thesaurierende Klasse AUD B | Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich) | Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) | Thesaurierende Klasse AUD E | Ausschüttende Klasse AUD I | Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) | Ausschüttende Klasse AUD T (Wöchentlich) |
|--|--|--------------------------------|--|--------------------------------|---|--|--------------------------------|-------------------------------|--|--|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 2.927.970 | 242.834 | 3.006.534 | 104.092 | 85.032 | 192.233 | 40.111 | 2.691.160 | 13.609.831 | 143.194 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 25.904 | – | 418.352 | 36.589 | 48 | 294.551 | 45.985 | 49.415 | 1.019.120 | 1.336 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (512.929) | (52.238) | (1.319.744) | (32.354) | (84.426) | (188.343) | (51.710) | (938.459) | (1.870.973) | (8.585) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 2.440.945 | 190.596 | 2.105.142 | 108.327 | 654 | 298.441 | 34.386 | 1.802.116 | 12.757.978 | 135.945 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 3.252.446 | 352.388 | 4.522.124 | 152.294 | 169.903 | 452.484 | 186.086 | 6.153.126 | 14.551.556 | 179.079 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 9.555 | – | 478.263 | 63.876 | 607 | 84.076 | 21.961 | 254.326 | 1.368.374 | 1.166 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (334.031) | (109.554) | (1.993.853) | (112.078) | (85.478) | (344.327) | (167.936) | (3.716.292) | (2.310.099) | (37.051) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 2.927.970 | 242.834 | 3.006.534 | 104.092 | 85.032 | 192.233 | 40.111 | 2.691.160 | 13.609.831 | 143.194 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse AUD T | Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich) | Thesaurierende Klasse CHF A | Thesaurierende Klasse CHF I | Thesaurierende Klasse CHF I2 | Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse CNY I (Monatlich) | Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) | Thesaurierende Klasse EUR A | Ausschüttende Klasse EUR A |
|--|--------------------------------|--|--------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|--|--|--|--------------------------------|-------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 169.905 | 982.013 | 319.845 | 432.280 | 176.009 | 191.923 | 2.682 | 1.065.293 | 1.112.989 | 418.681 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 20.843 | 14.335 | 2.455 | 17.291 | 73.974 | 754 | – | 109.148 | 518.681 | 143 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (71.406) | (109.486) | (83.935) | (432.664) | (32.408) | (34.963) | – | (220.122) | (1.352.037) | (66.501) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 119.342 | 886.862 | 238.365 | 16.907 | 217.575 | 157.714 | 2.682 | 954.319 | 279.633 | 352.323 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 97.037 | 1.360.593 | 395.532 | 47.592 | 213.840 | 208.694 | 181.377 | 1.449.596 | 1.361.660 | 457.422 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 90.853 | 195.811 | 40.740 | 401.833 | 28.911 | 3.945 | – | 150.440 | 504.330 | 3.569 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (17.985) | (574.391) | (116.427) | (17.145) | (66.742) | (20.716) | (178.695) | (534.743) | (753.001) | (42.310) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 169.905 | 982.013 | 319.845 | 432.280 | 176.009 | 191.923 | 2.682 | 1.065.293 | 1.112.989 | 418.681 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse EUR I | Ausschüttende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR I2 | Ausschüttende Klasse EUR I2 | Thesaurierende Klasse EUR I5* | Thesaurierende Klasse EUR M | Thesaurierende Klasse EUR Z | Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich) | Thesaurierende Klasse GBP A | Ausschüttende Klasse GBP A |
|--|--------------------------------|-------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|----------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--|--------------------------------|-------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 1.304.687 | 751.660 | 1.902.298 | 5.703.153 | – | 3.914 | 15.212 | 421.494 | 125.815 | 142.935 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 235.494 | – | 2.956.995 | 3.671.796 | – | – | – | 2.163 | – | 46 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (503.083) | (128.592) | (760.685) | (1.042.198) | – | (854) | – | – | (26.427) | (22.372) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 1.037.098 | 623.068 | 4.098.608 | 8.332.751 | – | 3.060 | 15.212 | 423.657 | 99.388 | 120.609 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 1.251.360 | 1.501.255 | 1.411.870 | 141.081 | 16.640.327 | 2.946 | 15.212 | 785.392 | 129.318 | 178.638 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 512.972 | 5.830 | 868.636 | 5.912.755 | – | 1.801 | – | 1.688 | – | 39 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (459.645) | (755.425) | (378.208) | (350.683) | (16.640.327) | (833) | – | (365.586) | (3.503) | (35.742) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 1.304.687 | 751.660 | 1.902.298 | 5.703.153 | – | 3.914 | 15.212 | 421.494 | 125.815 | 142.935 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse GBP I | Ausschüttende Klasse GBP I | Thesaurierende Klasse GBP I2 | Ausschüttende Klasse GBP I2 | Thesaurierende Klasse GBP Z | Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) | Thesaurierende Klasse SEK A | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | Thesaurierende Klasse SGD A | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) |
|--|--------------------------------|-------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--|--------------------------------|--|--------------------------------|--|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 362.285 | 881.445 | 46.512 | 16.921.590 | 12.701 | 5.896.017 | 626.951 | 1.638.642 | 108.171 | 13.466.807 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 4.960 | 9.982 | 65.479 | 10.368.432 | – | 3.089 | 5.557.328 | 15.494 | 204.439 | 745.002 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (32.359) | (494.658) | (2.720) | (5.028.981) | (3.433) | (398.220) | (783.430) | (278.771) | (143.821) | (3.411.878) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 334.886 | 396.769 | 109.271 | 22.261.041 | 9.268 | 5.500.886 | 5.400.849 | 1.375.365 | 168.789 | 10.799.931 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 362.702 | 1.655.037 | 52.756 | 3.185.857 | 6.639 | 6.325.073 | 695.642 | 1.953.557 | 127.467 | 19.014.699 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 236 | 50.288 | 18.513 | 15.798.271 | 7.062 | 82.205 | 135.137 | 47.155 | – | 1.046.046 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (653) | (823.880) | (24.757) | (2.062.538) | (1.000) | (511.261) | (203.828) | (362.070) | (19.296) | (6.593.938) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 362.285 | 881.445 | 46.512 | 16.921.590 | 12.701 | 5.896.017 | 626.951 | 1.638.642 | 108.171 | 13.466.807 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

| | Ausschüttende Klasse USD A Thesaurierende | | | Ausschüttende Klasse USD B Thesaurierende | | | | Ausschüttende Klasse USD C2 Thesaurierende | | | |
|--|--|--------------|--------------|--|--------------|--------------|---------------|---|------------------------------|---------------|--|
| | Ausschüttende (Wöchentlich) | Klasse USD A | Klasse USD A | Ausschüttende (Monatlich) | Klasse USD B | Klasse USD C | Klasse USD C1 | Ausschüttende Klasse USD C1 | Klasse USD C2 (Monatlich) | Klasse USD C2 | |
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 427.606 | 8.395.075 | 2.530.429 | 20.645.450 | 1.198.731 | 74.079 | 263.716 | 73.867 | 669.843 | 215.498 | |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 182 | 874.514 | 68.922 | 4.476.633 | 475.758 | – | – | 653 | 42.940 | 276 | |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (75.261) | (1.984.406) | (361.487) | (6.850.921) | (897.270) | (4.805) | (48.336) | (6.064) | (710.478) | (215.238) | |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 352.527 | 7.285.183 | 2.237.864 | 18.271.162 | 777.219 | 69.274 | 215.380 | 68.456 | 2.305 | 536 | |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 282.513 | 10.802.958 | 3.620.054 | 25.932.704 | 1.606.107 | 84.877 | 319.543 | 89.428 | 1.226.172 | 278.674 | |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 179.024 | 1.619.297 | 197.596 | 4.767.744 | 882.417 | – | – | 303 | 122.568 | 261 | |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (33.931) | (4.027.180) | (1.287.221) | (10.054.998) | (1.289.793) | (10.798) | (55.827) | (15.864) | (678.897) | (63.437) | |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 427.606 | 8.395.075 | 2.530.429 | 20.645.450 | 1.198.731 | 74.079 | 263.716 | 73.867 | 669.843 | 215.498 | |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

| | Ausschüttende Klasse USD E Thesaurierende (Monatlich) Klasse USD E | | Ausschüttende Klasse USD I Thesaurierende (Monatlich) Klasse USD I | | Ausschüttende Klasse USD I2 Thesaurierende (Monatlich) Klasse USD I2 Klasse USD I2 | | | Ausschüttende Klasse USD I4 Thesaurierende (Monatlich) Klasse USD M Klasse USD M | | | |
|--|--|-----------|--|-------------|--|-------------|--------------|--|-------------|----------|----------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 2.155.711 | 274.864 | 7.910.242 | 16.987.264 | 2.090.887 | 6.620.346 | 19.600.897 | 19.756.247 | 13.975.144 | 45.645 | 21.113 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 1.667.224 | 94.300 | 548.162 | 1.793.190 | 293.308 | 18.405 | 3.029.018 | 11.662.081 | 923.066 | 7.807 | 22.343 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (1.929.137) | (224.344) | (3.104.804) | (7.831.415) | (740.320) | (53.149) | (7.748.020) | (4.795.066) | – | (18.924) | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 1.893.798 | 144.820 | 5.353.600 | 10.949.039 | 1.643.875 | 6.585.602 | 14.881.895 | 26.623.262 | 14.898.210 | 34.528 | 43.456 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 2.836.482 | 315.621 | 11.152.610 | 17.515.806 | 4.464.055 | 7.343.830 | 27.499.697 | 10.777.295 | 18.079.681 | 49.242 | 41.770 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 1.072.069 | 218.024 | 4.726.773 | 4.362.177 | 211.675 | 301.822 | 2.475.433 | 12.865.165 | – | 8.734 | 133 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (1.752.840) | (258.781) | (7.969.141) | (4.890.719) | (2.584.843) | (1.025.306) | (10.374.233) | (3.886.213) | (4.104.537) | (12.331) | (20.790) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 2.155.711 | 274.864 | 7.910.242 | 16.987.264 | 2.090.887 | 6.620.346 | 19.600.897 | 19.756.247 | 13.975.144 | 45.645 | 21.113 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD P | Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) | Ausschüttende Klasse USD T (Wöchentlich) | Thesaurierende Klasse USD T | Ausschüttende Klasse USD U (Monatlich) | Thesaurierende Klasse USD U | Thesaurierende Klasse USD Z | Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich) | Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich) | Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) |
|--|--------------------------------|--|--|--------------------------------|--|--------------------------------|--------------------------------|--|---|--|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 412.350 | 23.357.518 | 306.646 | 631.356 | 109.686 | 860.009 | 5.126.090 | 6.845.279 | 134.051 | 1.349.132 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 66.906 | 3.193.377 | 8.779 | 521.618 | – | – | – | 2.370.687 | 10.153 | 793.513 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (324.519) | (4.559.430) | (25.000) | (325.788) | (1.812) | (352.969) | (1.971.379) | (3.584.026) | (135.946) | (678.066) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 154.737 | 21.991.465 | 290.425 | 827.186 | 107.874 | 507.040 | 3.154.711 | 5.631.940 | 8.258 | 1.464.579 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 664.802 | 25.143.726 | 335.777 | 717.447 | 109.686 | 1.023.568 | 5.546.591 | 10.350.000 | 305.726 | 2.340.000 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 118.320 | 4.115.134 | 9.152 | 348.411 | – | – | 1.050.065 | 2.613.298 | 17.028 | 1.184.623 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (370.772) | (5.901.342) | (38.283) | (434.502) | – | (163.559) | (1.470.566) | (6.118.019) | (188.703) | (2.175.491) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 412.350 | 23.357.518 | 306.646 | 631.356 | 109.686 | 860.009 | 5.126.090 | 6.845.279 | 134.051 | 1.349.132 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse ZAR E | Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) | Thesaurierende Klasse ZAR T |
|--|--------------------------------|--|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 66.616 | 28.203.849 | 112.608 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 4.164 | 2.246.458 | 41.659 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (39.160) | (4.594.714) | (35.799) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 31.620 | 25.855.593 | 118.468 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 114.268 | 30.713.417 | 157.249 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 61.094 | 3.450.302 | 67.013 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (108.746) | (5.959.870) | (111.654) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 66.616 | 28.203.849 | 112.608 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

InnovAsia 5G

| | Thesaurierende Klasse CHF I4 | Thesaurierende Klasse EUR A | Thesaurierende Klasse EUR I4 | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungs- gesichert) | Thesaurierende Klasse EUR X | Thesaurierende Klasse SGD A | Thesaurierende Klasse SGD I4 | Thesaurierende Klasse SGD X | Thesaurierende Klasse USD A | Thesaurierende Klasse USD I |
|--|---------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|---|--------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 73.557 | 44.689 | 126.139 | 3.853 | 494.894 | 2.031 | 52.763 | 26.368 | 19.159 | 476.000 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 5.000 | – | 700 | – | 1.000 | – | 9.486 | 346 | 535.520 | 282.000 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (14.001) | (42.150) | (37.895) | – | – | – | (2.576) | (7.983) | (23.923) | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 64.556 | 2.539 | 88.944 | 3.853 | 495.894 | 2.031 | 59.673 | 18.731 | 530.756 | 758.000 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 95.687 | 12.539 | 94.116 | 2.584 | 494.714 | 2.031 | 52.295 | 26.311 | 25.197 | 476.000 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 14.814 | 42.150 | 41.213 | 1.269 | 500 | – | 1.800 | 2.649 | 13.112 | 405.000 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (36.944) | (10.000) | (9.190) | – | (320) | – | (1.332) | (2.592) | (19.150) | (405.000) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 73.557 | 44.689 | 126.139 | 3.853 | 494.894 | 2.031 | 52.763 | 26.368 | 19.159 | 476.000 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

InnovAsia 5G (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD I4 | Thesaurierende Klasse USD M | Thesaurierende Klasse USD X |
|--|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 578.306 | 1.000 | 268.235 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 2.185 | – | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (129.215) | – | (81.678) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 451.276 | 1.000 | 186.557 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 758.228 | 1.000 | 285.914 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 120.679 | – | 68.759 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (300.601) | – | (86.438) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 578.306 | 1.000 | 268.235 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Japan Equity Engagement

| | Ausschüttende | | Thesaurierende | | Ausschüttende | | Thesaurierende | |
|--|----------------|---------------|---|---|---------------|--------------|----------------|--------------|
| | Klasse EUR I5* | Klasse GBP I5 | Klasse GBP I5 (nicht währungs- gesichert)* | Klasse GBP P (nicht währungs- gesichert) | Klasse JPY I | Klasse JPY I | Klasse JPY I5 | Klasse JPY Z |
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 6.356.690 | 39.504 | – | 2.242 | 347.161 | 507.443 | 673.747 | 4.840.035 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 2.662 | 7.695 | 1.104.106 | 1.469.580 | 34.275 | 3.180 | 231.160 | 786.147 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (6.356.690) | (13.789) | (4.031) | (151.965) | (293.000) | (497.000) | (151.726) | (2.687.766) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 2.662 | 33.410 | 1.100.075 | 1.319.857 | 88.436 | 13.623 | 753.181 | 2.938.416 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | – | 29.970 | – | 2.242 | 327.759 | 3.488.199 | 503.328 | 133.863 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 6.558.565 | 9.534 | – | – | 25.611 | 3.186 | 316.224 | 4.706.172 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (201.875) | – | – | – | (6.209) | (2.983.942) | (145.805) | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 6.356.690 | 39.504 | – | 2.242 | 347.161 | 507.443 | 673.747 | 4.840.035 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Macro Opportunities FX

| | Thesaurierende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR M* | Thesaurierende Klasse GBP Z | Thesaurierende Klasse SEK I | Ausschüttende Klasse SEK I | Thesaurierende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD X* | Thesaurierende Klasse USD Z |
|--|--------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 115.547 | – | 16.762 | 2.813.386 | 746 | 1.081 | – | 710.542 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 65.287 | – | – | 914.490 | – | – | – | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (45.737) | – | (14.757) | (3.557.520) | (373) | – | – | (702.583) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 135.097 | – | 2.005 | 170.356 | 373 | 1.081 | – | 7.959 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 553.740 | 2.749 | 16.762 | 2.350.496 | 217.428 | 1.081 | 1.294.647 | 473.699 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 41.991 | – | – | 1.998.140 | 13.272 | – | – | 256.410 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (480.184) | (2.749) | – | (1.535.250) | (229.954) | – | (1.294.647) | (19.567) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 115.547 | – | 16.762 | 2.813.386 | 746 | 1.081 | – | 710.542 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Multi-Asset Income**

| | Thesaurierende Klasse EUR I* | Ausschüttende Klasse GBP P* | Thesaurierende Klasse USD A* | Thesaurierende Klasse USD C1* | Thesaurierende Klasse USD I* | Ausschüttende Klasse USD I* | Thesaurierende Klasse USD I2* | Thesaurierende Klasse USD M* |
|--|---------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|----------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|----------------------------------|---------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | – | 2.332 | 652.893 | 235.557 | 59.117 | 12.352 | – | 147.152 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | – | 1.272 | – | – | – | – | 1.034 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | (2.332) | (654.165) | (235.557) | (59.117) | (12.352) | – | (148.186) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | – | – | – | – | – | – | – | – |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 57.768 | 2.332 | 652.502 | 292.728 | 108.506 | 21.895 | 678.552 | 210.688 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 29.413 | – | 59.774 | – | 247 | 4.310 | 27.208 | 9.186 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (87.181) | – | (59.383) | (57.171) | (49.636) | (13.853) | (705.760) | (72.722) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | – | 2.332 | 652.893 | 235.557 | 59.117 | 12.352 | – | 147.152 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

** Das Portfolio wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Next Generation Mobility

| | Thesaurierende Klasse EUR A | Thesaurierende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungs- gesichert) | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungs- gesichert) | Thesaurierende Klasse USD A | Thesaurierende Klasse USD C1 | Thesaurierende Klasse USD I | Ausschüttende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD M | Thesaurierende Klasse USD X |
|--|--------------------------------|--------------------------------|---|---|--------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 11.363 | 32.834 | 2.748.201 | 1.917.802 | 2.054.173 | 137.589 | 370.324 | 421.606 | 494.738 | 1.910.978 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 4.324 | – | 475.757 | 257.194 | 323.919 | – | 384.544 | 2.198 | 34.103 | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (4.627) | (28.874) | (887.743) | (396.276) | (422.830) | (50.175) | (231.472) | (46.735) | (122.351) | (632.611) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 11.060 | 3.960 | 2.336.215 | 1.778.720 | 1.955.262 | 87.414 | 523.396 | 377.069 | 406.490 | 1.278.367 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 13.186 | 409.524 | 2.575.102 | 1.815.622 | 1.901.560 | 219.776 | 930.498 | 531.011 | 588.779 | 2.209.933 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 900 | 28.874 | 1.077.534 | 331.074 | 574.460 | – | 111.239 | 28.095 | 97.045 | 211.124 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (2.723) | (405.564) | (904.435) | (228.894) | (421.847) | (82.187) | (671.413) | (137.500) | (191.086) | (510.079) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 11.363 | 32.834 | 2.748.201 | 1.917.802 | 2.054.173 | 137.589 | 370.324 | 421.606 | 494.738 | 1.910.978 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Next Generation Space Economy²

| | Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungs- gesichert)* | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungs- gesichert)* | Thesaurierende Klasse USD I* |
|--|--|---|---------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 443.187 | 113.032 | 300.000 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 476.691 | 290.893 | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (56.874) | (13.136) | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 863.004 | 390.789 | 300.000 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | – | – | – |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 446.026 | 113.032 | 300.000 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (2.839) | – | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 443.187 | 113.032 | 300.000 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Responsible Asian Debt – Hard Currency

| | Ausschüttende | | | | Ausschüttende | | | | Ausschüttende | |
|--|---------------|----------------|----------------|----------------|---------------|---------------|----------------|----------------|---------------|----------------|
| | Klasse USD A | Thesaurierende | Thesaurierende | Thesaurierende | Klasse USD I | Klasse USD I4 | Thesaurierende | Thesaurierende | Klasse USD X | Thesaurierende |
| | (Monatlich) | Klasse USD A | Klasse USD C1 | Klasse USD I | Klasse USD I | (Monatlich)* | Klasse USD I4* | Klasse USD M | (Monatlich)* | Klasse USD X |
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 35.120 | 119.210 | 19.456 | 30.051 | 1.171.040 | 1.000 | 1.000 | 55.388 | 1.000 | 2.193 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 321 | 2.725 | – | – | – | – | – | – | – | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (2.112) | (18.879) | (3.282) | (1.000) | (1.162.791) | – | – | (21.996) | – | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 33.329 | 103.056 | 16.174 | 29.051 | 8.249 | 1.000 | 1.000 | 33.392 | 1.000 | 2.193 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 35.619 | 171.476 | 40.715 | 41.226 | 955.959 | – | – | 67.231 | – | 1.000 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 249 | 776 | – | – | 1.162.791 | 1.000 | 1.000 | 7.891 | 1.000 | 1.193 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (748) | (53.042) | (21.259) | (11.175) | (947.710) | – | – | (19.734) | – | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 35.120 | 119.210 | 19.456 | 30.051 | 1.171.040 | 1.000 | 1.000 | 55.388 | 1.000 | 2.193 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Responsible Asian Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD Z* |
|--|---------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 848.201 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 4.891.550 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 5.739.751 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | – |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 848.201 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 848.201 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt

| | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich) | Thesaurierende Klasse CHF A | Ausschüttende Klasse CHF A | Thesaurierende Klasse CHF I | Ausschüttende Klasse CHF I | Thesaurierende Klasse CHF I2 | Ausschüttende Klasse CHF I2 | Thesaurierende Klasse CHF I5 | Thesaurierende Klasse CHF P |
|--|--|--|--------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 329.980 | 532.977 | 485.575 | 121.294 | 1.310.726 | 168.480 | 1.996.523 | 1.655.388 | 151.200 | 2.996.603 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 3.867 | 17.900 | 19.905 | – | 258.897 | 89.090 | 51.607 | – | – | 950.193 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (132.149) | (500.000) | (165.612) | (38.014) | (910.282) | (151.270) | (1.056.150) | (1.647.282) | (1.600) | (917.884) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 201.698 | 50.877 | 339.868 | 83.280 | 659.341 | 106.300 | 991.980 | 8.106 | 149.600 | 3.028.912 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 328.543 | 532.977 | 657.644 | 118.730 | 1.506.083 | 111.470 | 329.049 | 1.685.488 | 406.638 | 4.062.953 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 1.439 | – | 22.399 | 13.530 | 207.031 | 96.000 | 1.970.828 | 2.700 | – | 1.997.643 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (2) | – | (194.468) | (10.966) | (402.388) | (38.990) | (303.354) | (32.800) | (255.438) | (3.063.993) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 329.980 | 532.977 | 485.575 | 121.294 | 1.310.726 | 168.480 | 1.996.523 | 1.655.388 | 151.200 | 2.996.603 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse EUR A | Ausschüttende Klasse EUR A | Thesaurierende Klasse EUR I | Ausschüttende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR I2 | Ausschüttende Klasse EUR I2 | Thesaurierende Klasse EUR I5 | Thesaurierende Klasse EUR M | Ausschüttende Klasse EUR M | Thesaurierende Klasse EUR P |
|--|--------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 12.313.118 | 2.355.226 | 71.354.629 | 23.218.416 | 21.343.869 | 7.801.041 | 599.699 | 289.438 | 165.016 | 11.340.764 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 1.286.977 | 244.106 | 38.828.846 | 876.961 | 5.674.820 | 164 | 147.062 | 44.958 | 118.153 | 799.837 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (3.162.227) | (466.245) | (45.303.514) | (2.624.261) | (10.000.267) | (1.071.920) | (180.990) | (82.299) | (15.638) | (7.023.786) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 10.437.868 | 2.133.087 | 64.879.961 | 21.471.116 | 17.018.422 | 6.729.285 | 565.771 | 252.097 | 267.531 | 5.116.815 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 15.750.484 | 2.640.162 | 104.437.045 | 20.753.466 | 10.539.102 | 1.614.888 | 585.631 | 318.221 | 181.972 | 13.153.015 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 1.476.933 | 399.868 | 29.397.259 | 9.213.995 | 19.141.989 | 6.360.047 | 593.013 | 50.716 | 7.429 | 2.733.710 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (4.914.299) | (684.804) | (62.479.675) | (6.749.045) | (8.337.222) | (173.894) | (578.945) | (79.499) | (24.385) | (4.545.961) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 12.313.118 | 2.355.226 | 71.354.629 | 23.218.416 | 21.343.869 | 7.801.041 | 599.699 | 289.438 | 165.016 | 11.340.764 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse EUR U | Ausschüttende Klasse EUR X | Thesaurierende Klasse GBP A | Thesaurierende Klasse GBP I | Ausschüttende Klasse GBP I | Thesaurierende Klasse GBP I2 | Ausschüttende Klasse GBP I2 | Ausschüttende Klasse GBP I5 | Thesaurierende Klasse GBP P | Ausschüttende Klasse GBP P* |
|--|--------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 409.924 | 5.600.000 | 178.390 | 456.013 | 451.110 | 195.144 | 61.906.491 | 17.028.791 | 171.325 | – |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 259.021 | – | – | 32.236 | 107.971 | 1.114 | 3.844.487 | 4.959.455 | 131.835 | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (388.716) | – | (82.664) | (273.627) | (377.002) | (153.755) | (64.356.712) | (3.817.689) | (132.455) | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 280.229 | 5.600.000 | 95.726 | 214.622 | 182.079 | 42.503 | 1.394.266 | 18.170.557 | 170.705 | – |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 548.931 | 5.600.000 | 182.824 | 404.719 | 558.512 | 466.043 | 58.937.663 | 13.010.262 | 59.955 | 28.500 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 8.047 | – | 71.695 | 108.375 | 91.511 | 96.235 | 9.805.715 | 5.859.201 | 153.152 | 15.480 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (147.054) | – | (76.129) | (57.081) | (198.913) | (367.134) | (6.836.887) | (1.840.672) | (41.782) | (43.980) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 409.924 | 5.600.000 | 178.390 | 456.013 | 451.110 | 195.144 | 61.906.491 | 17.028.791 | 171.325 | – |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse JPY I | Ausschüttende Klasse JPY I | Thesaurierende Klasse SEK A | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | Thesaurierende Klasse USD A | Ausschüttende Klasse USD A | Thesaurierende Klasse USD C1 | Ausschüttende Klasse USD C1 | Thesaurierende Klasse USD I |
|--|--------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|--|--|--------------------------------|-------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 88.355.473 | 5.383.361 | 166.970 | 2.577.819 | 2.835.944 | 36.560.035 | 14.724.239 | 3.899.770 | 458.405 | 62.869.655 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 3.596.736 | 96.351 | 5.464 | 1.872.412 | 1.277.803 | 3.706.919 | 834.919 | 677 | 1.532 | 5.314.847 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (16.460.323) | – | (65.116) | (659.013) | (697.082) | (10.636.607) | (4.938.618) | (729.578) | (144.962) | (14.915.267) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 75.491.886 | 5.479.712 | 107.318 | 3.791.218 | 3.416.665 | 29.630.347 | 10.620.540 | 3.170.869 | 314.975 | 53.269.235 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 90.791.421 | 11.045.650 | 248.014 | 2.138.768 | 3.108.113 | 51.068.297 | 21.313.162 | 5.292.052 | 582.573 | 90.250.991 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 5.483.477 | 122.818 | 45.202 | 994.763 | 742.141 | 4.429.875 | 3.699.288 | – | 1.348 | 8.834.909 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (7.919.425) | (5.785.107) | (126.246) | (555.712) | (1.014.310) | (18.938.137) | (10.288.211) | (1.392.282) | (125.516) | (36.216.245) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 88.355.473 | 5.383.361 | 166.970 | 2.577.819 | 2.835.944 | 36.560.035 | 14.724.239 | 3.899.770 | 458.405 | 62.869.655 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

| | Ausschüttende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD I2 | Ausschüttende Klasse USD I2 | Thesaurierende Klasse USD I5 | Ausschüttende Klasse USD I5 | Thesaurierende Klasse USD M | Ausschüttende Klasse USD M | Thesaurierende Klasse USD P | Thesaurierende Klasse USD Z |
|--|-------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 9.453.599 | 13.796.794 | 10.271.003 | 462.275 | 2.565.820 | 4.240.903 | 1.222.416 | 16.556.554 | 1.153.935 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 1.798.419 | 1.114.455 | 1.600.872 | – | 365.525 | 820.671 | 160.057 | 3.883.877 | 981.050 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (2.195.711) | (11.999.779) | (10.544.431) | (71.677) | (1.171.885) | (851.911) | (341.110) | (5.493.837) | (275.056) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 9.056.307 | 2.911.470 | 1.327.444 | 390.598 | 1.759.460 | 4.209.663 | 1.041.363 | 14.946.594 | 1.859.929 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 22.169.862 | 10.053.832 | 12.404.415 | 541.892 | 1.700.784 | 4.959.069 | 1.049.439 | 16.647.169 | 2.069.373 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 1.607.356 | 10.196.253 | 1.738.668 | 17.599 | 964.069 | 522.220 | 348.065 | 3.334.781 | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (14.323.619) | (6.453.291) | (3.872.080) | (97.216) | (99.033) | (1.240.386) | (175.088) | (3.425.396) | (915.438) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 9.453.599 | 13.796.794 | 10.271.003 | 462.275 | 2.565.820 | 4.240.903 | 1.222.416 | 16.556.554 | 1.153.935 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement

| | Ausschüttende Klasse AUD A Thesaurierende | | | Ausschüttende Klasse CNY A Thesaurierende | | | Ausschüttende Thesaurierende | | | |
|--|--|--------------|--------------|--|--------------|--------------|------------------------------|---------------|--------------|--------------|
| | (Monatlich) | Klasse CHF A | Klasse CHF I | (Monatlich) | Klasse EUR A | Klasse EUR A | Klasse EUR I | Klasse EUR I2 | Klasse EUR M | Klasse EUR M |
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 168.383 | 73.530 | 19.499 | 24.316 | 1.043.186 | 372.075 | 3.313.293 | 518.941 | 92.174 | 92.293 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 22.122 | – | – | 1.199 | 758.046 | 763 | 1.472.839 | 3.074.524 | 9.174 | 8.912 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (29.731) | (34.320) | – | (1.100) | (768.754) | (94.416) | (899.098) | (72.300) | (9.583) | (12.599) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 160.774 | 39.210 | 19.499 | 24.415 | 1.032.478 | 278.422 | 3.887.034 | 3.521.165 | 91.765 | 88.606 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 60.909 | 79.530 | 19.499 | 22.899 | 1.296.606 | 390.699 | 4.424.657 | 88.001 | 157.391 | 85.831 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 113.584 | – | – | 2.267 | 279.134 | 12.100 | 1.189.077 | 444.840 | 4.437 | 16.061 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (6.110) | (6.000) | – | (850) | (532.554) | (30.724) | (2.300.441) | (13.900) | (69.654) | (9.599) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 168.383 | 73.530 | 19.499 | 24.316 | 1.043.186 | 372.075 | 3.313.293 | 518.941 | 92.174 | 92.293 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse GBP I | Ausschüttende Klasse GBP I | Thesaurierende Klasse GBP I2 | Ausschüttende Klasse GBP I2 | Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)* | Thesaurierende Klasse JPY I | Ausschüttende Klasse JPY I* | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | Thesaurierende Klasse USD A |
|--|--------------------------------|-------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|---|--------------------------------|--------------------------------|--|--|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 1.184.596 | 319.083 | 99.495 | 188.675 | 237.545 | 14.584.769 | 1.500.000 | 146.696 | 409.578 | 2.686.234 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 9.792 | 7.142.435 | 5 | – | 41.393 | 1.214.913 | – | 122.573 | 146.935 | 498.102 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (1.166.897) | (296.045) | (1.041) | (68.775) | (125.373) | (2.213.917) | – | (27.238) | (30.573) | (808.521) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 27.491 | 7.165.473 | 98.459 | 119.900 | 153.565 | 13.585.765 | 1.500.000 | 242.031 | 525.940 | 2.375.815 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 1.259.686 | 1.128.213 | 106.086 | 486.236 | – | 14.079.861 | – | 80.298 | 533.328 | 2.899.367 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | 157.817 | 5 | 8.833 | 279.363 | 1.728.546 | 1.500.000 | 166.027 | 31.026 | 1.718.379 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (75.090) | (966.947) | (6.596) | (306.394) | (41.818) | (1.223.638) | – | (99.629) | (154.776) | (1.931.512) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 1.184.596 | 319.083 | 99.495 | 188.675 | 237.545 | 14.584.769 | 1.500.000 | 146.696 | 409.578 | 2.686.234 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

| | Ausschüttende Klasse USD A | Thesaurierende Klasse USD C1 | Thesaurierende Klasse USD I | Ausschüttende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD I2 | Ausschüttende Klasse USD I2 | Thesaurierende Klasse USD I4* | Thesaurierende Klasse USD I5* | Thesaurierende Klasse USD M | Ausschüttende Klasse USD M |
|--|-------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 1.203.389 | 385.271 | 8.546.826 | 317.102 | 7.171.291 | 237.376 | – | 2.514.199 | 796.656 | 445.414 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 34.856 | – | 8.965.863 | 22.417.004 | – | 16.589 | 281.000 | – | 204.183 | 283.518 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (224.480) | (130.226) | (9.027.453) | (52.014) | (7.065.704) | (218.858) | – | – | (727.957) | (535.590) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 1.013.765 | 255.045 | 8.485.236 | 22.682.092 | 105.587 | 35.107 | 281.000 | 2.514.199 | 272.882 | 193.342 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 1.111.564 | 434.343 | 7.172.968 | 6.141.951 | 8.374.379 | 273.202 | – | – | 279.280 | 116.292 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 145.212 | – | 5.316.388 | 83.377 | – | 42.153 | – | 2.514.199 | 599.751 | 341.786 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (53.387) | (49.072) | (3.942.530) | (5.908.226) | (1.203.088) | (77.979) | – | – | (82.375) | (12.664) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 1.203.389 | 385.271 | 8.546.826 | 317.102 | 7.171.291 | 237.376 | – | 2.514.199 | 796.656 | 445.414 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

Thesaurierende
Klasse USD Z**Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr****Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile**

| | |
|---|-----------|
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 776.456 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 74.483 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (444.746) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 406.193 |

Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr**Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile**

| | |
|---|-----------|
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 857.639 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 135.961 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (217.144) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 776.456 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Strategic Income

| | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse AUD Z (Monatlich) | Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)* | Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) | Thesaurierende Klasse EUR A* | Thesaurierende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR M | Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse GBP I (Monatlich)* | Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) |
|--|--|--|---|--|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--|---|--|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 471.279 | 8.514.232 | – | 870.921 | 5.400 | 655.596 | 135.233 | 225.209 | – | 1.370.873 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 11.281.729 | 7.692.003 | 1.281.499 | 5.631.637 | 32.038 | 447.649 | 29.935 | 4.396.759 | 649.150 | 136.313.875 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (2.042.371) | (647.399) | (52.764) | (1.343.657) | (836) | (359.555) | (60.825) | (1.243.356) | – | (23.822.183) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 9.710.637 | 15.558.836 | 1.228.735 | 5.158.901 | 36.602 | 743.690 | 104.343 | 3.378.612 | 649.150 | 113.862.565 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 589.284 | 2.408.654 | – | 1.123.616 | – | 567.731 | 221.329 | 335.052 | – | 2.042.998 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 3.243 | 6.405.843 | – | 37.229 | 5.400 | 227.899 | 5.611 | 2.950 | – | 1.096.532 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (121.248) | (300.265) | – | (289.924) | – | (140.034) | (91.707) | (112.793) | – | (1.768.657) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 471.279 | 8.514.232 | – | 870.921 | 5.400 | 655.596 | 135.233 | 225.209 | – | 1.370.873 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Strategic Income (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse JPY I | Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungs- gesichert) | Ausschüttende Klasse JPY I CG | Ausschüttende Klasse JPY I | Thesaurierende Klasse JPY Z* | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | Thesaurierende Klasse SGD A | Ausschüttende Klasse SGD I (Monatlich) | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | Thesaurierende Klasse USD A |
|--|--------------------------------|---|----------------------------------|-------------------------------|---------------------------------|--|--------------------------------|--|--|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 11.761.499 | 2.348.460 | 6.742.455 | 9.131.838 | 10.979.747 | 1.418.467 | 216.898 | 648.072 | 4.909.524 | 26.750.249 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 653.954 | – | – | 5.300 | – | 3.002.669 | 525.874 | 232.717 | 32.570.536 | 17.296.531 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (1.862.728) | (2.795) | (5.572.566) | (9.131.838) | (5.020.682) | (751.775) | (105.415) | (120.430) | (6.089.117) | (4.702.088) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 10.552.725 | 2.345.665 | 1.169.889 | 5.300 | 5.959.065 | 3.669.361 | 637.357 | 760.359 | 31.390.943 | 39.344.692 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 12.356.093 | 2.351.292 | 6.692.084 | 9.131.838 | – | 1.732.128 | 337.853 | 372.945 | 6.948.278 | 25.485.732 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 6.848.895 | – | 552.581 | – | 13.900.889 | 114.346 | 112.338 | 427.307 | 1.107.963 | 7.267.596 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (7.443.489) | (2.832) | (502.210) | – | (2.921.142) | (428.007) | (233.293) | (152.180) | (3.146.717) | (6.003.079) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 11.761.499 | 2.348.460 | 6.742.455 | 9.131.838 | 10.979.747 | 1.418.467 | 216.898 | 648.072 | 4.909.524 | 26.750.249 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Strategic Income (Fortsetzung)

| | Ausschüttende Klasse USD A | Thesaurierende Klasse USD C1 | Thesaurierende Klasse USD I | Ausschüttende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD M | Ausschüttende Klasse USD M | Thesaurierende Klasse USD Z |
|--|-------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 1.624.416 | 4.399.957 | 30.162.828 | 2.693.726 | 6.188.277 | 994.062 | 3.459.057 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 1.068.937 | – | 9.491.191 | 5.940.870 | 4.271.764 | 461.089 | 140.478 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (287.970) | (847.594) | (11.875.634) | (1.965.860) | (1.353.326) | (208.537) | (152.988) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 2.405.383 | 3.552.363 | 27.778.385 | 6.668.736 | 9.106.715 | 1.246.614 | 3.446.547 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 1.656.220 | 6.626.975 | 30.078.171 | 2.459.752 | 6.343.104 | 987.823 | 3.748.472 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 204.194 | – | 8.255.717 | 690.416 | 1.507.999 | 142.142 | 67.969 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (235.998) | (2.227.018) | (8.171.060) | (456.442) | (1.662.826) | (135.903) | (357.384) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 1.624.416 | 4.399.957 | 30.162.828 | 2.693.726 | 6.188.277 | 994.062 | 3.459.057 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Sustainable Asia High Yield

| | Thesaurierende Klasse EUR X* | Thesaurierende Klasse GBP X* | Ausschüttende Klasse GBP X* | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | Thesaurierende Klasse USD A | Thesaurierende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD X* | Thesaurierende Klasse USD Z* | Ausschüttende Klasse USD Z* |
|--|---------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--|--------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 429.777 | 22.390 | – | 1.000 | 1.000 | 1.225 | – | 2.408.657 | 721.340 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | – | – | 3.032 | – | – | – | – | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (387.077) | (18.394) | – | (1.339) | – | – | – | (2.000) | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 42.700 | 3.996 | – | 2.693 | 1.000 | 1.225 | – | 2.406.657 | 721.340 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | – | – | – | 1.000 | 1.000 | 2.498.000 | – | – | – |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 4.048.830 | 22.390 | 1.022.396 | – | – | 1.225 | 5.819 | 3.212.677 | 721.340 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (3.619.053) | – | (1.022.396) | – | – | (2.498.000) | (5.819) | (804.020) | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 429.777 | 22.390 | – | 1.000 | 1.000 | 1.225 | – | 2.408.657 | 721.340 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Corporate Debt

| | Thesaurierende Klasse CHF I | Thesaurierende Klasse CHF I4* | Thesaurierende Klasse EUR A | Thesaurierende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR I3 | Thesaurierende Klasse EUR M | Ausschüttende Klasse EUR M | Thesaurierende Klasse EUR X | Thesaurierende Klasse GBP I | Thesaurierende Klasse SEK A |
|--|--------------------------------|----------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 1.034.420 | 456.611 | 63.496 | 45.983 | 24.272 | 56.094 | 57.553 | 4.068.252 | 2.158 | 33.205 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 215.000 | – | 1.263 | 19 | 2.844 | 1.565 | 14.313 | – | – | 1.522 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (2.000) | (456.611) | (57.408) | (19.340) | (4.409) | (2.524) | (3.770) | – | (1.371) | (11.761) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 1.247.420 | – | 7.351 | 26.662 | 22.707 | 55.135 | 68.096 | 4.068.252 | 787 | 22.966 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 2.121.106 | 943.136 | 213.963 | 47.988 | 32.268 | 61.544 | 63.965 | 4.068.252 | 9.545 | 52.436 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 272.329 | – | 80.000 | – | 2.912 | 727 | 4.837 | – | – | 8.746 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (1.359.015) | (486.525) | (230.467) | (2.005) | (10.908) | (6.177) | (11.249) | – | (7.387) | (27.977) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 1.034.420 | 456.611 | 63.496 | 45.983 | 24.272 | 56.094 | 57.553 | 4.068.252 | 2.158 | 33.205 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Corporate Debt (Fortsetzung)

| | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | Thesaurierende Klasse USD A | Thesaurierende Klasse USD C1 | Thesaurierende Klasse USD I | Ausschüttende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD I2 | Thesaurierende Klasse USD I5* | Thesaurierende Klasse USD M | Ausschüttende Klasse USD M |
|--|--|--------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|---------------------------------|----------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 85.553 | 518.363 | 69.555 | 1.594.074 | 301.029 | 65.000 | 27.458 | 80.293 | 91.458 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 27.479 | 22.132 | – | 139.711 | – | – | – | 70.559 | 4.164 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (19.821) | (153.479) | (1.982) | (424.700) | (37.580) | (25.000) | (27.458) | (64.040) | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 93.211 | 387.016 | 67.573 | 1.309.085 | 263.449 | 40.000 | – | 86.812 | 95.622 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 457.011 | 568.237 | 106.599 | 1.548.109 | 308.361 | 75.000 | 37.058 | 97.693 | 95.176 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 7.945 | 68.018 | – | 1.069.743 | 3.408 | 5.000 | 3.400 | – | 14.252 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (379.403) | (117.892) | (37.044) | (1.023.778) | (10.740) | (15.000) | (13.000) | (17.400) | (17.970) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 85.553 | 518.363 | 69.555 | 1.594.074 | 301.029 | 65.000 | 27.458 | 80.293 | 91.458 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency²

| | Thesaurierende Klasse EUR I3* | Thesaurierende Klasse EUR I4* | Thesaurierende Klasse EUR I5* | Thesaurierende Klasse EUR X* | Thesaurierende Klasse USD I* | Thesaurierende Klasse USD I5* |
|--|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|----------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 2.156.822 | – | 249.922 | 7.706.142 | 1.000 | 7.267.654 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 834.545 | 25.687.200 | – | 5.776.200 | – | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (2.208.841) | (2.361.063) | (249.922) | (5.093.698) | – | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 782.526 | 23.326.137 | – | 8.388.644 | 1.000 | 7.267.654 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | – | – | – | – | – | – |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 2.183.738 | – | 1.368.322 | 8.140.270 | 1.000 | 7.267.654 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (26.916) | – | (1.118.400) | (434.128) | – | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 2.156.822 | – | 249.922 | 7.706.142 | 1.000 | 7.267.654 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Tactical Macro¹

| | Thesaurierende Klasse USD I* | Thesaurierende Klasse USD I5* | Thesaurierende Klasse USD Z* |
|--|---------------------------------|----------------------------------|---------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | – | – | – |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 1.000 | 32.912 | 2.605.310 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | – | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 1.000 | 32.912 | 2.605.310 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Ultra Short Term Euro Bond

| | Thesaurierende Klasse CHF P* | Thesaurierende Klasse CHF U | Thesaurierende Klasse EUR A | Thesaurierende Klasse EUR I | Ausschüttende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR I2 | Thesaurierende Klasse EUR I5 | Thesaurierende Klasse EUR M | Thesaurierende Klasse EUR U | Thesaurierende Klasse EUR Z |
|--|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 7.900 | 66.596 | 53.957 | 5.092.957 | 15.867 | 501.554 | 1.640.462 | 806 | 40.833 | 22.356 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | 3.907 | 186.949 | 3.494.687 | 83.255 | 303.369 | 279.617 | 94.643 | 64.043 | 6.774 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | (14.790) | (42.032) | (2.800.141) | (46.860) | – | (232.633) | (5.534) | (5.410) | (10.100) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 7.900 | 55.713 | 198.874 | 5.787.503 | 52.262 | 804.923 | 1.687.446 | 89.915 | 99.466 | 19.030 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | – | 20.604 | 88.648 | 6.724.282 | 5.457 | 556.414 | 2.214.472 | 252 | 59.498 | 597.498 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 7.900 | 68.248 | 73.875 | 5.559.527 | 10.872 | 202.752 | 149.283 | 566 | 23.401 | 447.028 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | (22.256) | (108.566) | (7.190.852) | (462) | (257.612) | (723.293) | (12) | (42.066) | (1.022.170) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 7.900 | 66.596 | 53.957 | 5.092.957 | 15.867 | 501.554 | 1.640.462 | 806 | 40.833 | 22.356 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Ultra Short Term Euro Bond (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD Z |
|--|--------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 24.446 | 805.000 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 87.633 | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (91.795) | (230.000) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 20.284 | 575.000 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 40.059 | 805.000 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 144.957 | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (160.570) | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 24.446 | 805.000 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies

| | Thesaurierende Klasse CHF I | Thesaurierende Klasse CHF I5* | Thesaurierende Klasse EUR A | Thesaurierende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR I2 | Thesaurierende Klasse EUR I5* | Thesaurierende Klasse EUR M | Thesaurierende Klasse EUR P* | Thesaurierende Klasse GBP I | Thesaurierende Klasse GBP I2 |
|--|--------------------------------|----------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|----------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 331.704 | 139.713 | 3.198.588 | 14.958.535 | 1.401.062 | 614.817 | 168.291 | 2.888.663 | 6.717.230 | 75.869.469 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 151.053 | 37.452 | 259.067 | 2.480.933 | 25.140 | 16.894 | – | 147.958 | 1.476.635 | 26.752.166 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (269.641) | (177.165) | (2.776.185) | (16.436.870) | (686.876) | (631.711) | (92.243) | (3.013.653) | (6.923.408) | (46.627.435) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 213.116 | – | 681.470 | 1.002.598 | 739.326 | – | 76.048 | 22.968 | 1.270.457 | 55.994.200 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 522.520 | 47.000 | 5.650.747 | 30.954.859 | 1.254.213 | 916.447 | 61.124 | – | 5.450.362 | 65.191.635 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 93.716 | 92.713 | 1.954.523 | 10.782.886 | 373.070 | 218.897 | 129.902 | 3.670.532 | 3.885.691 | 26.424.053 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (284.532) | – | (4.406.682) | (26.779.210) | (226.221) | (520.527) | (22.735) | (781.869) | (2.618.823) | (15.746.219) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 331.704 | 139.713 | 3.198.588 | 14.958.535 | 1.401.062 | 614.817 | 168.291 | 2.888.663 | 6.717.230 | 75.869.469 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

| | Ausschüttende Klasse GBP I2* | Thesaurierende Klasse GBP I5 | Thesaurierende Klasse GBP P | Thesaurierende Klasse GBP Z | Thesaurierende Klasse JPY I* | Thesaurierende Klasse SGD A* | Thesaurierende Klasse USD A | Thesaurierende Klasse USD C1 | Thesaurierende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD I2 |
|--|---------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 7.635 | 20.811.248 | 65.755.680 | 41.713 | 4.210.727 | 10.011 | 6.893.263 | 664.412 | 21.190.138 | 4.960.786 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 28.547 | 1.274.912 | 18.481.299 | – | – | 814.157 | 663.357 | – | 17.697.579 | 502.688 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (7.245) | (18.922.276) | (49.819.930) | – | (9.754) | (823.711) | (3.930.530) | (250.138) | (21.332.893) | (1.240.135) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 28.937 | 3.163.884 | 34.417.049 | 41.713 | 4.200.973 | 457 | 3.626.090 | 414.274 | 17.554.824 | 4.223.339 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | – | 11.930.455 | 45.118.664 | 40.900 | – | – | 3.687.353 | 841.285 | 14.516.127 | 6.375.720 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 7.661 | 11.079.640 | 44.868.761 | 813 | 4.210.727 | 10.011 | 5.207.190 | – | 9.221.872 | 807.263 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (26) | (2.198.847) | (24.231.745) | – | – | – | (2.001.280) | (176.873) | (2.547.861) | (2.222.197) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 7.635 | 20.811.248 | 65.755.680 | 41.713 | 4.210.727 | 10.011 | 6.893.263 | 664.412 | 21.190.138 | 4.960.786 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD I5 | Thesaurierende Klasse USD M | Thesaurierende Klasse USD P | Thesaurierende Klasse USD Z |
|--|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 1.920.389 | 1.297.914 | 4.656.985 | 2.256.709 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 183.568 | 92.708 | 214.528 | 8.919 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (1.126.306) | (860.754) | (4.234.386) | (1.307.438) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 977.651 | 529.868 | 637.127 | 958.190 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 1.529.220 | 871.364 | 616.287 | 829.875 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 453.543 | 933.686 | 5.246.410 | 1.463.217 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (62.374) | (507.136) | (1.205.712) | (36.383) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 1.920.389 | 1.297.914 | 4.656.985 | 2.256.709 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Trading2**

| | Thesaurierende Klasse EUR X* | Thesaurierende Klasse USD X* |
|--|---------------------------------|---------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 66.029.923 | 1.818.579 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 644.896 | 471.245 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (66.674.819) | (2.289.824) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | – | – |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | – | – |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 67.400.238 | 2.685.584 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (1.370.315) | (867.005) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 66.029.923 | 1.818.579 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

** Das Portfolio wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Equity

| | Thesaurierende Klasse JPY I3* | Thesaurierende Klasse USD A | Thesaurierende Klasse USD I | Ausschüttende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD M* |
|--|----------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 3.336.540 | 227.315 | 150.640 | 229.104 | 1.000 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 495.845 | 35.050 | 33.651 | – | 562.322 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (10.154) | (61.723) | (17.287) | – | (9.105) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 3.822.231 | 200.642 | 167.004 | 229.104 | 554.217 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | – | 61.736 | 55.448 | 229.104 | – |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 3.341.989 | 199.320 | 124.911 | – | 1.000 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (5.449) | (33.741) | (29.719) | – | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 3.336.540 | 227.315 | 150.640 | 229.104 | 1.000 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Equity Index PutWrite

| | Thesaurierende Klasse EUR I | Ausschüttende Klasse EUR I3 | Thesaurierende Klasse EUR I4 | Ausschüttende Klasse EUR I4* | Thesaurierende Klasse EUR M | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungs- gesichert) | Ausschüttende Klasse GBP I3 | Ausschüttende Klasse GBP I3 | Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungs- gesichert)* | Thesaurierende Klasse GBP I4* |
|--|--------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|---|--------------------------------|--------------------------------|--|----------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 44.461 | 549.260 | 66.048 | – | 27.502 | 2.427.688 | 6.272.119 | 21.276.762 | – | – |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 315.495 | 78.615 | 240 | 2.748 | 86 | 217.259 | 5.145.591 | 4.786.168 | 785 | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (53.521) | (123.794) | (22.009) | – | (1.904) | (1.584.815) | (2.489.010) | (3.472.032) | – | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 306.435 | 504.081 | 44.279 | 2.748 | 25.684 | 1.060.132 | 8.928.700 | 22.590.898 | 785 | – |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 47.525 | 220.080 | 180.864 | – | 33.905 | 1.802.720 | 2.248.157 | 3.198.627 | – | 846 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 11.664 | 425.297 | 422 | – | – | 1.340.219 | 4.553.797 | 19.638.605 | – | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (14.728) | (96.117) | (115.238) | – | (6.403) | (715.251) | (529.835) | (1.560.470) | – | (846) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 44.461 | 549.260 | 66.048 | – | 27.502 | 2.427.688 | 6.272.119 | 21.276.762 | – | – |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Equity Index PutWrite (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungs- gesichert) | Ausschüttende Klasse GBP I4* | Ausschüttende Klasse GBP P (nicht währungs- gesichert) | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | Thesaurierende Klasse USD A | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) | Thesaurierende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD I3* | Ausschüttende Klasse USD I3 | Thesaurierende Klasse USD I4 |
|--|--|---------------------------------|--|--|--------------------------------|--|--------------------------------|----------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 9.386.183 | – | 458.474 | 9.705 | 950.719 | 1.097.810 | 4.024.747 | – | 2.042.656 | 385.879 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 18.942 | 43.332 | 91.944 | 4.841 | 415.505 | 2.043.767 | 898.789 | – | 522.685 | 118.043 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (5.733.554) | – | (174.214) | (4.905) | (474.710) | (3.140.685) | (545.352) | – | (270.689) | (126.157) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 3.671.571 | 43.332 | 376.204 | 9.641 | 891.514 | 892 | 4.378.184 | – | 2.294.652 | 377.765 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 8.895.632 | 786 | 287.113 | 10.180 | 911.802 | 1.127.931 | 4.539.876 | 849 | 1.053.159 | 1.879.518 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 1.547.300 | – | 358.721 | 4.767 | 500.722 | 692.990 | 1.088.996 | – | 1.203.212 | 1.407.434 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (1.056.749) | (786) | (187.360) | (5.242) | (461.805) | (723.111) | (1.604.125) | (849) | (213.715) | (2.901.073) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 9.386.183 | – | 458.474 | 9.705 | 950.719 | 1.097.810 | 4.024.747 | – | 2.042.656 | 385.879 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Equity Index PutWrite (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD M | Thesaurierende Klasse USD Z |
|--|--------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 98.157 | 2.712.179 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 24.441 | 1.093.031 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (34.958) | (519.704) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 87.640 | 3.285.506 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 107.362 | 2.855.112 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 15.269 | 632.431 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (24.474) | (775.364) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 98.157 | 2.712.179 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Large Cap Value

| | Thesaurierende Klasse EUR A* (nicht währungs-gesichert)* | Thesaurierende Klasse EUR I* (nicht währungs-gesichert)* | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungs-gesichert)* | Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungs-gesichert)* | Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungs-gesichert)* | Thesaurierende Klasse GBP I* (nicht währungs-gesichert)* | Ausschüttende Klasse GBP I* (nicht währungs-gesichert)* | Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungs-gesichert)* | Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungs-gesichert)* | | |
|--|---|---|--|--|---|---|--|---|--|----------|-------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 13.958 | 39.526 | 1.468.204 | 3.967.984 | 1.436.743 | 11.258.613 | 2.528 | 843 | 2.528 | 843 | 70.274.876 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 65.490 | 28.220 | 2.417.441 | 18.901.030 | 159.284 | 45.314 | – | 54.613 | 29.700 | 657.290 | 10.973.706 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (22.468) | (44.244) | (958.684) | (6.285.461) | (336.837) | (722.476) | – | (3.312) | (410) | (42.080) | (9.630.756) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 56.980 | 23.502 | 2.926.961 | 16.583.553 | 1.259.190 | 10.581.451 | 2.528 | 52.144 | 31.818 | 616.053 | 71.617.826 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | – | – | – | – | – | – | – | – | – | – | – |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 13.958 | 39.526 | 1.627.094 | 4.250.285 | 1.491.188 | 13.047.025 | 2.528 | 843 | 2.528 | 843 | 73.478.088 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | – | (158.890) | (282.301) | (54.445) | (1.788.412) | – | – | – | – | (3.203.212) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 13.958 | 39.526 | 1.468.204 | 3.967.984 | 1.436.743 | 11.258.613 | 2.528 | 843 | 2.528 | 843 | 70.274.876 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Large Cap Value (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungs- gesichert)* | Ausschüttende Klasse GBP P* | Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungs- gesichert)* | Ausschüttende Klasse GBP Y (nicht währungs- gesichert)* | Thesaurierende Klasse USD A* | Thesaurierende Klasse USD I | Ausschüttende Klasse USD I4* | Thesaurierende Klasse USD I5* | Thesaurierende Klasse USD M* | Thesaurierende Klasse USD Y* |
|--|--|-----------------------------------|--|---|---------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|----------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 101.890 | 2.678 | 7.624.449 | 5.601 | 6.754.569 | 35.996.493 | 5.756.675 | 5.300 | 5.176.603 | – |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 107.842 | – | 3.957.303 | 26.432 | 3.474.454 | 23.051.960 | 422.550 | – | 1.232.124 | 10.023.997 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (49.068) | – | (1.516.450) | (1.307) | (3.239.667) | (24.200.529) | (1.650.663) | (800) | (4.000.711) | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 160.664 | 2.678 | 10.065.302 | 30.726 | 6.989.356 | 34.847.924 | 4.528.562 | 4.500 | 2.408.016 | 10.023.997 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | – | – | – | – | – | 200.000 | – | – | – | – |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 102.520 | 2.678 | 8.502.130 | 5.636 | 7.269.038 | 41.035.790 | 5.929.016 | 5.300 | 5.418.346 | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (630) | – | (877.681) | (35) | (514.469) | (5.239.297) | (172.341) | – | (241.743) | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 101.890 | 2.678 | 7.624.449 | 5.601 | 6.754.569 | 35.996.493 | 5.756.675 | 5.300 | 5.176.603 | – |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Large Cap Value (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD Z* |
|--|---------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 1.344.067 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 19.275 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (1.343.051) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 20.291 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | – |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 1.344.067 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 1.344.067 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Long Short Equity

| | Thesaurierende Klasse EUR A | Thesaurierende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR I3 | Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungs- gesichert)* | Thesaurierende Klasse EUR M | Thesaurierende Klasse GBP I3 (nicht währungs- gesichert)* | Ausschüttende Klasse GBP I3 | Thesaurierende Klasse SGD A1 | Thesaurierende Klasse USD A (PF) | Thesaurierende Klasse USD A |
|--|--------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|---|--------------------------------|---|--------------------------------|---------------------------------|--|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 57.075 | 3.268.450 | 3.439.272 | – | 316.553 | – | 54.852 | 12.714 | 233.693 | 1.265.021 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 137 | 723.435 | 424.140 | – | 786 | – | 90.971 | 1.527 | 14.454 | 109.187 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (34.453) | (1.408.427) | (849.874) | – | (70.584) | – | (8.234) | (7.704) | (134.798) | (194.226) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 22.759 | 2.583.458 | 3.013.538 | – | 246.755 | – | 137.589 | 6.537 | 113.349 | 1.179.982 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 143.682 | 4.846.206 | 11.178.440 | 2.771 | 377.171 | 2.455 | 225.433 | 22.176 | 227.237 | 1.487.680 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 172.023 | 326.393 | 783.023 | – | 13.018 | 2.183 | 4.879 | 5.032 | 21.487 | 276.405 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (258.630) | (1.904.149) | (8.522.191) | (2.771) | (73.636) | (4.638) | (175.460) | (14.494) | (15.031) | (499.064) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 57.075 | 3.268.450 | 3.439.272 | – | 316.553 | – | 54.852 | 12.714 | 233.693 | 1.265.021 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Long Short Equity (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD A1 | Ausschüttende Klasse USD I (PF) | Thesaurierende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD I3 | Thesaurierende Klasse USD M | Thesaurierende Klasse USD U | Thesaurierende Klasse USD Z |
|--|---------------------------------|---------------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 1.094.746 | 2.642.224 | 3.674.697 | 1.186.852 | 111.946 | 534.775 | 267.357 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 89.727 | 807.930 | 1.587.062 | 202.787 | 13.482 | – | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (214.157) | (874.484) | (3.192.984) | (472.093) | (47.685) | (446.233) | (66.319) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 970.316 | 2.575.670 | 2.068.775 | 917.546 | 77.743 | 88.542 | 201.038 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 1.253.410 | 2.802.577 | 2.090.293 | 10.442.455 | 109.302 | 542.601 | 419.811 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 214.886 | 375.719 | 3.885.914 | 1.985.919 | 2.738 | – | 75.111 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (373.550) | (536.072) | (2.301.510) | (11.241.522) | (94) | (7.826) | (227.565) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 1.094.746 | 2.642.224 | 3.674.697 | 1.186.852 | 111.946 | 534.775 | 267.357 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities

| | Thesaurierende Klasse AUD E | Thesaurierende Klasse AUD T | Thesaurierende Klasse EUR I3 | Thesaurierende Klasse EUR M | Thesaurierende Klasse EUR1 A | Thesaurierende Klasse EUR1 I | Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungs- gesichert) | Thesaurierende Klasse SGD A | Thesaurierende Klasse USD B |
|--|--------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|---|--------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 93.786 | 110.356 | 84.141 | 30.996 | 78.036 | 125.756 | 1.065 | 579.622 | 807.081 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 26.899 | 41.328 | – | 1.733 | 11.143 | 57.842 | – | 685.550 | 717.450 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (55.705) | (30.296) | – | (5.758) | (17.317) | (69.735) | – | (637.579) | (970.676) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 64.980 | 121.388 | 84.141 | 26.971 | 71.862 | 113.863 | 1.065 | 627.593 | 553.855 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 103.392 | 105.957 | 84.141 | 34.214 | 85.750 | 154.894 | 73.977 | 542.847 | 865.824 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 49.631 | 38.631 | – | 2.346 | 15.445 | 67.811 | – | 242.498 | 1.269.038 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (59.237) | (34.232) | – | (5.564) | (23.159) | (96.949) | (72.912) | (205.723) | (1.327.781) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 93.786 | 110.356 | 84.141 | 30.996 | 78.036 | 125.756 | 1.065 | 579.622 | 807.081 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD C1 | Thesaurierende Klasse USD C2 | Thesaurierende Klasse USD E | Thesaurierende Klasse USD I2* | Thesaurierende Klasse USD I3 | Ausschüttende Klasse USD I3 | Thesaurierende Klasse USD M | Thesaurierende Klasse USD T | Thesaurierende Klasse USD U | Thesaurierende Klasse USD Z |
|--|---------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|----------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 136.170 | 43.555 | 724.570 | – | 883.721 | 215.406 | 464.616 | 950.340 | 2.057.222 | 12.941 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | 612 | 295.828 | 1.000 | 3.330 | – | 116.205 | 557.491 | – | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (18.551) | (43.632) | (378.434) | – | (224.527) | – | (218.447) | (607.473) | (420.614) | (930) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 117.619 | 535 | 641.964 | 1.000 | 662.524 | 215.406 | 362.374 | 900.358 | 1.636.608 | 12.011 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 175.037 | 61.643 | 713.406 | – | 1.368.306 | 275.603 | 2.743.383 | 685.660 | 2.287.465 | 11.728 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | 34.603 | 594.543 | – | 3.413 | – | 162.523 | 715.901 | 32.378 | 1.213 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (38.867) | (52.691) | (583.379) | – | (487.998) | (60.197) | (2.441.290) | (451.221) | (262.621) | – |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 136.170 | 43.555 | 724.570 | – | 883.721 | 215.406 | 464.616 | 950.340 | 2.057.222 | 12.941 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD1 A | Thesaurierende Klasse USD1 I | Ausschüttende Klasse USD1 I | Thesaurierende Klasse ZAR B | Thesaurierende Klasse ZAR C2 | Thesaurierende Klasse ZAR E | Thesaurierende Klasse ZAR T |
|--|---------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 2.345.397 | 5.765.989 | 174.175 | 171.064 | 2.779 | 247.002 | 219.960 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 324.075 | 526.299 | 56.274 | 168.398 | 618 | 260.588 | 110.817 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (878.437) | (2.203.372) | (56.244) | (228.788) | (3.224) | (364.110) | (150.661) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 1.791.035 | 4.088.916 | 174.205 | 110.674 | 173 | 143.480 | 180.116 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 2.606.938 | 9.791.044 | 254.798 | 146.610 | 7.079 | 239.157 | 165.854 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 1.106.851 | 2.335.683 | 26.230 | 242.602 | 233 | 159.012 | 259.962 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (1.368.392) | (6.360.738) | (106.853) | (218.148) | (4.533) | (151.167) | (205.856) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 2.345.397 | 5.765.989 | 174.175 | 171.064 | 2.779 | 247.002 | 219.960 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities

| | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) | Thesaurierende Klasse AUD B | Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)* | Thesaurierende Klasse AUD C2* | Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) | Thesaurierende Klasse AUD E | Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) | Thesaurierende Klasse AUD T | Thesaurierende Klasse CHF A |
|--|--|--|--------------------------------|--|----------------------------------|--|--------------------------------|--|--------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 675.732 | 492.551 | 138.287 | 1.807 | – | 245.324 | 121.348 | 462.964 | 368.420 | 139.881 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 12.444 | 46.222 | 43.342 | – | – | 19.919 | 26.286 | 120.444 | 71.826 | – |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (285.769) | (209.383) | (55.885) | (1.807) | – | (40.952) | (94.274) | (127.450) | (138.280) | (37.505) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 402.407 | 329.390 | 125.744 | – | – | 224.291 | 53.360 | 455.958 | 301.966 | 102.376 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 547.802 | 528.145 | 159.224 | 9.268 | 4.628 | 226.887 | 131.627 | 370.189 | 348.355 | 145.606 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 561.190 | 401.435 | 139.425 | 182 | 744 | 157.592 | 110.452 | 491.866 | 186.159 | 7.970 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (433.260) | (437.029) | (160.362) | (7.643) | (5.372) | (139.155) | (120.731) | (399.091) | (166.094) | (13.695) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 675.732 | 492.551 | 138.287 | 1.807 | – | 245.324 | 121.348 | 462.964 | 368.420 | 139.881 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse EUR A | Thesaurierende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR M | Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) | Thesaurierende Klasse SGD A | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | Thesaurierende Klasse USD A | Ausschüttende Klasse USD A | Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) | Thesaurierende Klasse USD B |
|--|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--|--------------------------------|--|--------------------------------|-------------------------------|--|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 133.521 | 550.981 | 48.760 | 7.160.831 | 28.524 | 3.425.409 | 10.009.919 | 925.030 | 2.528.277 | 1.279.147 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 35.925 | 25.361 | 3.364 | 540.387 | 13.501 | 86.168 | 1.452.660 | 3.420 | 540.383 | 444.491 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (54.100) | (71.954) | (3.608) | (3.143.574) | (14.164) | (996.003) | (3.769.092) | (136.721) | (988.978) | (976.131) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 115.346 | 504.388 | 48.516 | 4.557.644 | 27.861 | 2.515.574 | 7.693.487 | 791.729 | 2.079.682 | 747.507 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 221.920 | 2.188.596 | 27.810 | 7.690.618 | 41.774 | 4.190.452 | 10.643.671 | 1.003.155 | 2.658.868 | 1.533.723 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 808.215 | 115.823 | 27.222 | 3.362.015 | 54.661 | 1.521.105 | 3.000.057 | 98.848 | 2.723.404 | 2.264.820 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (896.614) | (1.753.438) | (6.272) | (3.891.802) | (67.911) | (2.286.148) | (3.633.809) | (176.973) | (2.853.995) | (2.519.396) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 133.521 | 550.981 | 48.760 | 7.160.831 | 28.524 | 3.425.409 | 10.009.919 | 925.030 | 2.528.277 | 1.279.147 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD C1 | Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)* | Thesaurierende Klasse USD C2* | Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) | Thesaurierende Klasse USD E | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) | Thesaurierende Klasse USD I | Ausschüttende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD I2 | Thesaurierende Klasse USD M |
|--|---------------------------------|--|----------------------------------|--|--------------------------------|--|--------------------------------|-------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 1.229.746 | 33.343 | 25.679 | 1.159.742 | 925.767 | 23.259 | 5.613.666 | 552.034 | 895.705 | 3.629.307 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | 9.180 | 275 | 186.730 | 177.748 | – | 1.148.152 | 34.829 | – | 142.543 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (293.707) | (42.523) | (25.954) | (435.826) | (539.575) | – | (2.754.295) | (55.773) | (16.092) | (1.257.944) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 936.039 | – | – | 910.646 | 563.940 | 23.259 | 4.007.523 | 531.090 | 879.613 | 2.513.906 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 1.778.770 | 59.343 | 36.053 | 1.226.573 | 1.350.073 | 27.397 | 5.679.976 | 516.818 | 84.179 | 4.177.044 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | – | 29.337 | 32.134 | 1.183.941 | 872.491 | 539 | 2.502.125 | 96.207 | 891.081 | 1.015.838 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (549.024) | (55.337) | (42.508) | (1.250.772) | (1.296.797) | (4.677) | (2.568.435) | (60.991) | (79.555) | (1.563.575) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 1.229.746 | 33.343 | 25.679 | 1.159.742 | 925.767 | 23.259 | 5.613.666 | 552.034 | 895.705 | 3.629.307 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

| | Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) | Thesaurierende Klasse USD T | Thesaurierende Klasse USD Z | Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich) | Thesaurierende Klasse ZAR B | Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)* | Thesaurierende Klasse ZAR C2 | Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) | Thesaurierende Klasse ZAR E | Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) | Thesaurierende Klasse ZAR T |
|--|--|--------------------------------|--------------------------------|--|--------------------------------|--|---------------------------------|--|--------------------------------|--|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 1.332.629 | 1.205.244 | 194.495 | 1.218.015 | 197.018 | 26.163 | 5.956 | 641.792 | 154.149 | 861.697 | 213.911 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 325.133 | 272.790 | 1.362 | 64.684 | 38.501 | – | – | 134.508 | 52.498 | 166.334 | 89.973 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (508.228) | (419.921) | (123.096) | (281.025) | (138.514) | (26.163) | (4.180) | (257.427) | (71.735) | (241.390) | (139.919) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 1.149.534 | 1.058.113 | 72.761 | 1.001.674 | 97.005 | – | 1.776 | 518.873 | 134.912 | 786.641 | 163.965 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 1.360.408 | 1.316.547 | 442.390 | 1.178.531 | 209.941 | 51.876 | 6.127 | 718.416 | 124.544 | 799.891 | 158.545 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 1.053.254 | 1.224.710 | 281 | 1.079.663 | 209.050 | 11.624 | 154 | 1.475.483 | 162.432 | 572.158 | 221.048 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (1.081.033) | (1.336.013) | (248.176) | (1.040.179) | (221.973) | (37.337) | (325) | (1.552.107) | (132.827) | (510.352) | (165.682) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 1.332.629 | 1.205.244 | 194.495 | 1.218.015 | 197.018 | 26.163 | 5.956 | 641.792 | 154.149 | 861.697 | 213.911 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Small Cap

| | Thesaurierende Klasse AUD B | Thesaurierende Klasse AUD C2 | Thesaurierende Klasse AUD E | Thesaurierende Klasse AUD T | Thesaurierende Klasse EUR A | Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungs- gesichert) | Thesaurierende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungs- gesichert) | Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungs- gesichert) | Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungs- gesichert)* |
|--|--------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|---|--------------------------------|---|--|---|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 108.173 | 1.690 | 97.829 | 111.847 | 148.159 | 29.210 | 189.681 | 211.363 | 1.467.828 | 3.871.698 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 66.284 | – | 59.405 | 27.859 | 8.459 | 10.000 | 215.043 | 80.862 | 170.598 | 739.200 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (29.129) | (680) | (34.911) | (22.119) | (73.780) | (12.762) | (60.222) | (31.997) | (1.119.218) | (123.000) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 145.328 | 1.010 | 122.323 | 117.587 | 82.838 | 26.448 | 344.502 | 260.228 | 519.208 | 4.487.898 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 140.649 | 1.166 | 118.110 | 100.934 | 176.331 | 17.463 | 656.580 | 271.757 | 1.299.867 | – |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 128.598 | 680 | 27.564 | 58.608 | 80.686 | 14.654 | 365.442 | 577.331 | 251.023 | 7.311.198 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (161.074) | (156) | (47.845) | (47.695) | (108.858) | (2.907) | (832.341) | (637.725) | (83.062) | (3.439.500) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 108.173 | 1.690 | 97.829 | 111.847 | 148.159 | 29.210 | 189.681 | 211.363 | 1.467.828 | 3.871.698 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Small Cap (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse EUR M | Thesaurierende Klasse EUR Z | Ausschüttende Klasse JPY I | Thesaurierende Klasse USD A | Ausschüttende Klasse USD A | Thesaurierende Klasse USD B | Thesaurierende Klasse USD C2 | Thesaurierende Klasse USD E | Thesaurierende Klasse USD I | Ausschüttende Klasse USD I |
|--|--------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 13.758 | 18.895 | 901.455.981 | 3.946.798 | 658.004 | 388.279 | 3.384 | 161.293 | 8.382.330 | 1.118.497 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 11.023 | 374 | 116.852.155 | 632.739 | 16.607 | 897.834 | 330 | 387.845 | 2.375.399 | 88.468 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (3.716) | – | (273.717.702) | (915.725) | (42.088) | (856.669) | (3.560) | (281.426) | (3.202.110) | (158.449) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 21.065 | 19.269 | 744.590.434 | 3.663.812 | 632.523 | 429.444 | 154 | 267.712 | 7.555.619 | 1.048.516 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 9.727 | 18.640 | 1.123.196.288 | 6.258.516 | 727.056 | 460.497 | 7.917 | 358.092 | 7.891.915 | 1.485.829 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 4.123 | 255 | 232.598.449 | 553.685 | 78.375 | 595.156 | 12.727 | 176.074 | 3.782.275 | 101.087 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (92) | – | (454.338.756) | (2.865.403) | (147.427) | (667.374) | (17.260) | (372.873) | (3.291.860) | (468.419) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 13.758 | 18.895 | 901.455.981 | 3.946.798 | 658.004 | 388.279 | 3.384 | 161.293 | 8.382.330 | 1.118.497 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Small Cap (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD I3 | Thesaurierende Klasse USD M | Thesaurierende Klasse USD T | Thesaurierende Klasse USD Z | Thesaurierende Klasse ZAR E | Thesaurierende Klasse ZAR T |
|--|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 7.496 | 177.791 | 364.357 | 120.834 | 81.361 | 96.280 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 189 | 115.791 | 256.086 | 1.462 | 19.771 | 36.544 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (244) | (64.523) | (284.517) | (37.729) | (68.514) | (58.550) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 7.441 | 229.059 | 335.926 | 84.567 | 32.618 | 74.274 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 5.040 | 3.928.128 | 337.309 | 145.644 | 75.771 | 133.102 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 7.022 | 80.513 | 213.833 | – | 49.994 | 73.599 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (4.566) | (3.830.850) | (186.785) | (24.810) | (44.404) | (110.421) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 7.496 | 177.791 | 364.357 | 120.834 | 81.361 | 96.280 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Small Cap Intrinsic Value

| | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungs- gesichert) | Thesaurierende Klasse GBP I2 (nicht währungs- gesichert) | Thesaurierende Klasse JPY I3 (nicht währungs- gesichert)* | Thesaurierende Klasse USD A | Thesaurierende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD I2* | Thesaurierende Klasse USD M |
|--|---|--|---|--------------------------------|--------------------------------|----------------------------------|--------------------------------|
| Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 4.206.288 | 1.414.380 | – | 461.520 | 5.064.335 | 3.900.000 | 31.526 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 3.974.667 | 551.054 | 633.142 | 76.050 | 1.935.998 | 3.228.340 | 739 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (1.057.070) | (131.482) | – | (119.624) | (904.660) | – | (8.917) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 7.123.885 | 1.833.952 | 633.142 | 417.946 | 6.095.673 | 7.128.340 | 23.348 |
| Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr | | | | | | | |
| Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | | | | | | | |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres | 1.966.688 | 882.278 | – | 374.861 | 4.798.391 | – | 28.431 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | 3.144.051 | 636.778 | – | 168.042 | 838.670 | 3.900.000 | 5.075 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile | (904.451) | (104.676) | – | (81.383) | (572.726) | – | (1.980) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres | 4.206.288 | 1.414.380 | – | 461.520 | 5.064.335 | 3.900.000 | 31.526 |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

¹ Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

² Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE

Der Manager hat für jede Klasse Anspruch auf eine Gebühr in Bezug auf Managementdienste, die er für jedes Portfolio erbringt (die „Managementgebühr“). Darüber hinaus hat der Manager Anspruch auf eine Gebühr von 0,025 % in Bezug auf die von ihm der Gesellschaft bereitgestellten administrativen Supportdienste.

Die maximale jährliche Gebühr, die der Gesellschaft in Bezug auf ein Portfolio in Rechnung gestellt wird, beträgt 2,5 % seines NIW. Die aktuelle Managementgebühr, die in Bezug auf jedes Portfolio zahlbar ist, wird im betreffenden Nachtrag veröffentlicht. Die aktuellen Sätze für die Managementgebühr der einzelnen Anlageklassen sind nachstehend aufgeführt.

Die Managementgebühr läuft täglich auf und ist monatlich rückwirkend am Ende eines jeden Kalendermonats zahlbar. Sofern im Nachtrag des betreffenden Portfolios keine anders lautenden Angaben gemacht werden, bezahlt der Manager die in Bezug auf ein Portfolio bestellten Sub-Investment-Manager oder Anlageberater aus seiner Managementgebühr. Der Manager hat ferner Anspruch auf Erstattung aller Spesen durch die Gesellschaft, die ihm (oder seinen Beauftragten) bei der Erfüllung seiner (ihrer) Pflichten entstehen, und zahlt diese erstatteten Spesen an den jeweiligen Dienstleister.

| 5G Connectivity | Management- gebühr |
|---|-----------------------|
| Thesaurierende Klasse AUD A | 1,70 % |
| Thesaurierende Klasse AUD I2 | 0,68 % |
| Thesaurierende Klasse CHF A | 1,70 % |
| Thesaurierende Klasse CHF I | 0,85 % |
| Thesaurierende Klasse CHF I2 | 0,68 % |
| Thesaurierende Klasse CNY A | 1,70 % |
| Thesaurierende Klasse CNY I2 | 0,68 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 1,70 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) | 1,70 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 0,85 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | 0,85 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 0,68 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 0,43 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | 1,70 % |
| Thesaurierende Klasse GBP A | 1,70 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | 0,85 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I2 | 0,68 % |
| Thesaurierende Klasse HKD A | 1,70 % |
| Thesaurierende Klasse HKD I2 | 0,68 % |
| Thesaurierende Klasse SGD A | 1,70 % |
| Thesaurierende Klasse SGD I2 | 0,68 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,70 % |
| Thesaurierende Klasse USD E | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,85 % |
| Ausschüttende Klasse USD I | 0,85 % |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 0,68 % |
| Thesaurierende Klasse USD I3 | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 0,43 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 1,70 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,00 % |
| Thesaurierende Klasse ZAR A | 1,70 % |
| Thesaurierende Klasse ZAR E | 1,80 % |

| China A-Share Equity | Management- gebühr |
|---|-----------------------|
| Thesaurierende Klasse CNY I | 0,90 % |
| Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) | 0,90 % |
| Ausschüttende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) | 0,90 % |

| China Bond | Management- gebühr |
|--|-----------------------|
| Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) | 1,30 % |
| Ausschüttende Klasse CNY I | 0,65 % |
| Thesaurierende Klasse CNY Z | 0,00 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I2 | 0,52 % |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) (nicht währungsgesichert) | 1,30 % |
| Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) | 0,65 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,00 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z (nicht währungsgesichert) | 0,00 % |

| China Equity | Management- gebühr |
|------------------------------|-----------------------|
| Thesaurierende Klasse CHF I | 1,10 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 1,85 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 1,10 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Z | 0,00 % |
| Ausschüttende Klasse GBP A | 1,85 % |
| Thesaurierende Klasse SGD A | 1,85 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,85 % |
| Ausschüttende Klasse USD A | 1,85 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 1,10 % |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 0,88 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 1,85 % |
| Thesaurierende Klasse USD U | 1,45 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,00 % |

| Climate Innovation | Management- gebühr |
|-----------------------------|-----------------------|
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,70 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,85 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

| Climate Innovation (Fortsetzung) | Management- gebühr | Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung) | Management- gebühr |
|---|-----------------------|--|-----------------------|
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 0,43 % | Thesaurierende Klasse GBP I | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,00 % | Thesaurierende Klasse GBP I2 | 0,48 % |
| CLO Income | | Ausschüttende Klasse GBP I2 | 0,48 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 1,50 % | Thesaurierende Klasse GBP P | 0,57 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 0,75 % | Ausschüttende Klasse GBP P | 0,57 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I2 | 0,60 % | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse GBP Z | 0,00 % | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse SEK I | 0,75 % | Thesaurierende Klasse USD A | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,50 % | Ausschüttende Klasse USD A | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,75 % | Thesaurierende Klasse USD C1 | 1,20 % |
| Ausschüttende Klasse USD I | 0,75 % | Thesaurierende Klasse USD I | 0,60 % |
| Ausschüttende Klasse USD I2 | 0,60 % | Ausschüttende Klasse USD I | 0,60 % |
| Ausschüttende Klasse USD I5 | 0,38 % | Thesaurierende Klasse USD I2 | 0,48 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,00 % | Ausschüttende Klasse USD I2 | 0,48 % |
| Commodities | | Thesaurierende Klasse USD M | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | 0,65 % | Ausschüttende Klasse USD M | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 | 0,33 % | Thesaurierende Klasse USD P | 0,57 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,40 % | Thesaurierende Klasse USD Z | 0,00 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,65 % | Developed Market FMP – 2027 | |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 0,33 % | Thesaurierende Klasse EUR A | 0,65 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 1,40 % | Ausschüttende Klasse EUR I | 0,30 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,00 % | Thesaurierende Klasse USD A | 0,65 % |
| Corporate Hybrid Bond | | Ausschüttende Klasse USD A | 0,65 % |
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | 1,20 % | Thesaurierende Klasse USD I | 0,30 % |
| Thesaurierende Klasse CHF P | 0,57 % | Ausschüttende Klasse USD I | 0,30 % |
| Ausschüttende Klasse CHF P | 0,57 % | Thesaurierende Klasse USD X | 0,40 % |
| Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) | 1,20 % | Ausschüttende Klasse USD X | 0,40 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 1,20 % | Emerging Market Debt - Hard Currency | |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 0,60 % | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | 1,40 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I | 0,60 % | Ausschüttende Klasse AUD I | 0,70 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 0,48 % | Thesaurierende Klasse CAD I3 (nicht währungsgesichert) | 0,49 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I2 | 0,48 % | Thesaurierende Klasse CHF I2 | 0,56 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I3 | 0,42 % | Thesaurierende Klasse CHF P | 0,67 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 0,30 % | Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) | 1,40 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 1,20 % | Thesaurierende Klasse EUR A | 1,40 % |
| Ausschüttende Klasse EUR M | 1,20 % | Thesaurierende Klasse EUR I | 0,70 % |
| Thesaurierende Klasse EUR P | 0,57 % | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | 0,70 % |
| Ausschüttende Klasse EUR P | 0,57 % | Ausschüttende Klasse EUR I | 0,70 % |
| | | Thesaurierende Klasse EUR I2 | 0,56 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

| Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung) | Management- gebühr | Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung) | Management- gebühr |
|---|-------------------------------|--|-------------------------------|
| Ausschüttende Klasse EUR I2 | 0,56 % | Thesaurierende Klasse EUR I | 0,75 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I3 | 0,49 % | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | 0,75 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I4 | 0,42 % | Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert) | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) | 0,35 % | Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) | 0,45 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 1,40 % | Thesaurierende Klasse EUR Y (nicht währungsgesichert) | 0,36 % |
| Ausschüttende Klasse EUR M | 1,40 % | Thesaurierende Klasse GBP I | 0,75 % |
| Thesaurierende Klasse EUR P | 0,67 % | Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) | 0,45 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Z | 0,00 % | Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) | 0,45 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I | 0,70 % | Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert) | 0,36 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I | 0,70 % | Thesaurierende Klasse SEK A | 1,50 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I2 | 0,56 % | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 1,50 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I2 | 0,56 % | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,50 % |
| Thesaurierende Klasse GBP P | 0,67 % | Thesaurierende Klasse USD A | 1,50 % |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) | 1,40 % | Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse JPY I | 0,70 % | Thesaurierende Klasse USD B | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse SEK A | 1,40 % | Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich) | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse SEK I2 | 0,56 % | Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) | 1,80 % |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 1,40 % | Thesaurierende Klasse USD E | 1,80 % |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,40 % | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) | 0,75 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,40 % | Thesaurierende Klasse USD I | 0,75 % |
| Ausschüttende Klasse USD A | 1,40 % | Ausschüttende Klasse USD I | 0,75 % |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 1,40 % | Thesaurierende Klasse USD I2 | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,70 % | Thesaurierende Klasse USD I5 | 0,38 % |
| Ausschüttende Klasse USD I | 0,70 % | Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 0,56 % | Thesaurierende Klasse USD T | 1,80 % |
| Ausschüttende Klasse USD I2 | 0,56 % | Thesaurierende Klasse USD X | 0,38 % |
| Ausschüttende Klasse USD I3 | 0,49 % | Thesaurierende Klasse USD Y | 0,36 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 1,40 % | Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich) | 1,80 % |
| Ausschüttende Klasse USD M | 1,40 % | Thesaurierende Klasse ZAR B | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD P | 0,67 % | Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich) | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD X | 0,47 % | Thesaurierende Klasse ZAR C2 | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,00 % | Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) | 1,80 % |
| | | Thesaurierende Klasse ZAR E | 1,80 % |
| | | Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) | 1,80 % |
| | | Thesaurierende Klasse ZAR T | 1,80 % |
| | | | |
| Emerging Market Debt - Local Currency | | Emerging Market Debt Blend | |
| Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) | 1,80 % | Ausschüttende Klasse AUD I3 | 0,49 % |
| Thesaurierende Klasse AUD B | 1,80 % | Thesaurierende Klasse EUR A | 1,40 % |
| Thesaurierende Klasse AUD C2 | 1,80 % | Thesaurierende Klasse EUR I | 0,70 % |
| Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) | 1,80 % | | |
| Thesaurierende Klasse AUD E | 1,80 % | | |
| Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) | 1,80 % | | |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

| | | | |
|--|-------------------------------|--|-------------------------------|
| Thesaurierende Klasse AUD T | 1,80 % | Ausschüttende Klasse EUR I | 0,70 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 1,50 % | Thesaurierende Klasse EUR I2 | 0,56 % |
| Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung) | Management- gebühr | Emerging Markets Equity (Fortsetzung) | Management- gebühr |
| Ausschüttende Klasse EUR I2 | 0,56 % | Ausschüttende Klasse CAD I2 | 0,80 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I3 | 0,49 % | Thesaurierende Klasse EUR I | 1,00 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) | 0,42 % | Thesaurierende Klasse EUR M | 2,00 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 0,35 % | Thesaurierende Klasse EUR Z | 0,00 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 1,40 % | Thesaurierende Klasse GBP I | 1,00 % |
| Ausschüttende Klasse EUR M | 1,40 % | Thesaurierende Klasse GBP Z | 0,00 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Z | 0,00 % | Thesaurierende Klasse USD A | 2,00 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I | 0,70 % | Thesaurierende Klasse USD B | 2,00 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | 0,70 % | Thesaurierende Klasse USD C2 | 2,00 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I | 0,70 % | Thesaurierende Klasse USD E | 2,00 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | 0,70 % | Thesaurierende Klasse USD I | 1,00 % |
| Thesaurierende Klasse GBP P | 0,67 % | Thesaurierende Klasse USD M | 2,00 % |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | 0,67 % | Thesaurierende Klasse USD T | 2,00 % |
| Thesaurierende Klasse GBP Z | 0,00 % | Thesaurierende Klasse USD Z | 0,00 % |
| Thesaurierende Klasse NOK U | 1,05 % | Thesaurierende Klasse ZAR B | 2,00 % |
| Thesaurierende Klasse SEK A | 1,40 % | Thesaurierende Klasse ZAR C2 | 2,00 % |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 1,40 % | Thesaurierende Klasse ZAR E | 2,00 % |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,40 % | Thesaurierende Klasse ZAR T | 2,00 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,40 % | | |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 1,40 % | Euro Bond | |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,70 % | Thesaurierende Klasse EUR I | 0,35 % |
| Ausschüttende Klasse USD I | 0,70 % | Ausschüttende Klasse EUR I | 0,35 % |
| Ausschüttende Klasse USD I2 | 0,56 % | | |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 0,35 % | Euro Bond Absolute Return | |
| Thesaurierende Klasse USD M | 1,40 % | Thesaurierende Klasse EUR I | 0,45 % |
| Ausschüttende Klasse USD M | 1,40 % | Ausschüttende Klasse EUR I | 0,45 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,00 % | Thesaurierende Klasse EUR I5 | 0,23 % |
| | | Thesaurierende Klasse USD Z | 0,00 % |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | | | |
| Thesaurierende Klasse AUD I2 | 0,48 % | European High Yield Bond | |
| Thesaurierende Klasse NOK I | 0,60 % | Thesaurierende Klasse CHF I | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse NOK I3 | 0,42 % | Thesaurierende Klasse EUR I | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,60 % | Thesaurierende Klasse EUR I2 | 0,48 % |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 0,48 % | Thesaurierende Klasse EUR I5 | 0,30 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,00 % | Thesaurierende Klasse EUR M | 1,20 % |
| | | Thesaurierende Klasse EUR X | 0,20 % |
| Emerging Markets Equity | | Thesaurierende Klasse EUR Y | 0,10 % |
| Thesaurierende Klasse AUD B | 2,00 % | Ausschüttende Klasse EUR Y | 0,10 % |
| Thesaurierende Klasse AUD C2 | 2,00 % | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse AUD E | 2,00 % | Thesaurierende Klasse USD I | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse AUD T | 2,00 % | Thesaurierende Klasse USD X | 0,20 % |
| Ausschüttende Klasse CAD I (nicht währungsgesichert) | 1,00 % | | |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

| European High Yield Bond (Fortsetzung) | Management- gebühr |
|--|-----------------------|
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,00 % |

| European Sustainable Equity | |
|---|--------|
| Ausschüttende Klasse EUR A | 1,50 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 0,60 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I | 0,60 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I3 | 0,42 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 0,30 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 1,50 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Z | 0,00 % |
| Thesaurierende Klasse USD A (nicht währungsgesichert) | 1,50 % |
| Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse USD M (nicht währungsgesichert) | 1,50 % |

| Event Driven | |
|------------------------------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR I | 1,00 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 | 0,50 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I5 | 0,50 % |
| Thesaurierende Klasse GBP P | 0,95 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 1,00 % |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 0,50 % |

| Global Bond | |
|---|--------|
| Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) | 0,75 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I Benchmark Währungsgesicherte Klasse | 0,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 0,40 % |
| Thesaurierende Klasse USD I Benchmark Währungsgesicherte Klasse | 0,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 0,40 % |
| Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) | 0,75 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,00 % |
| Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) | 0,75 % |

| Global Diversified Income FMP – 2024 | |
|--------------------------------------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR A | 0,75 % |
| Ausschüttende Klasse EUR A | 0,75 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I | 0,35 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I | 0,35 % |
| Ausschüttende Klasse HKD A | 0,75 % |
| Ausschüttende Klasse SGD A | 0,75 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 0,75 % |

| Global Diversified Income FMP – 2024 (Fortsetzung) | Management- gebühr |
|--|-----------------------|
| Ausschüttende Klasse USD A | 0,75 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,35 % |
| Ausschüttende Klasse USD I | 0,35 % |
| Thesaurierende Klasse USD X | 0,40 % |
| Ausschüttende Klasse USD X | 0,40 % |

| Global Equity Megatrends | |
|---|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR I | 0,85 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | 1,70 % |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | 0,81 % |
| Thesaurierende Klasse SGD A | 1,70 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,70 % |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 1,70 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,85 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 1,70 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,00 % |

| Global Flexible Credit Income | |
|-------------------------------|--------|
| Thesaurierende Klasse CAD I5 | 0,30 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 | 0,30 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,60 % |
| Ausschüttende Klasse USD I | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,00 % |

| Global High Yield SDG Engagement | |
|----------------------------------|--------|
| Ausschüttende Klasse AUD I | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse CHF I4 | 0,37 % |
| Ausschüttende Klasse CHF I4 | 0,37 % |
| Thesaurierende Klasse CHF X | 1,10 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I4 | 0,37 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I4 | 0,37 % |
| Thesaurierende Klasse EUR X | 1,10 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Z (PF) | 0,10 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I4 | 0,37 % |
| Thesaurierende Klasse GBP X | 1,10 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,60 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

| Global High Yield SDG Engagement (Fortsetzung) | Management- gebühr | Global Sustainable Equity (Fortsetzung) | Management- gebühr |
|--|-----------------------|---|-----------------------|
| Thesaurierende Klasse USD I4 | 0,37 % | Thesaurierende Klasse USD Z | 0,00 % |
| Ausschüttende Klasse USD M | 1,20 % | | |
| Thesaurierende Klasse USD X | 1,10 % | Global Sustainable Value | |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,00 % | Thesaurierende Klasse EUR M | 0,90 % |
| | | Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert) | 0,23 % |
| Global Investment Grade Credit | | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | 0,43 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 0,30 % | Thesaurierende Klasse USD A | 0,90 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,30 % | Thesaurierende Klasse USD I | 0,45 % |
| Thesaurierende Klasse USD X | 0,10 % | Thesaurierende Klasse USD I3 | 0,32 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,00 % | Thesaurierende Klasse USD Z | 0,00 % |
| | | | |
| Global Opportunistic Bond | | High Yield Bond | |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 0,30 % | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse GBP P | 0,29 % | Thesaurierende Klasse AUD A | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 0,60 % | Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,30 % | Thesaurierende Klasse AUD B | 1,80 % |
| Ausschüttende Klasse USD I | 0,30 % | Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich) | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 0,24 % | Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,00 % | Thesaurierende Klasse AUD E | 1,80 % |
| | | Ausschüttende Klasse AUD I | 0,60 % |
| Global Real Estate Securities | | Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 1,50 % | Ausschüttende Klasse AUD T (Wöchentlich) | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert) | 0,00 % | Thesaurierende Klasse AUD T | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse GBP Z | 0,00 % | Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich) | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,50 % | Thesaurierende Klasse CHF A | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD CI | 1,50 % | Thesaurierende Klasse CHF I | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,75 % | Thesaurierende Klasse CHF I2 | 0,50 % |
| Ausschüttende Klasse USD I5 | 0,38 % | Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 1,50 % | Ausschüttende Klasse CNY I (Monatlich) | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,00 % | Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) | 1,20 % |
| | | Thesaurierende Klasse EUR A | 1,20 % |
| Global Sustainable Equity | | Ausschüttende Klasse EUR A | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) | 0,30 % | Thesaurierende Klasse EUR I | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | 1,50 % | Ausschüttende Klasse EUR I | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert) | 0,00 % | Thesaurierende Klasse EUR I2 | 0,50 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | 0,60 % | Ausschüttende Klasse EUR I2 | 0,50 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert) | 0,30 % | Thesaurierende Klasse EUR M | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,50 % | Thesaurierende Klasse EUR Z | 0,00 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,60 % | Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich) | 1,20 % |
| Ausschüttende Klasse USD I | 0,60 % | Thesaurierende Klasse GBP A | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 1,50 % | Ausschüttende Klasse GBP A | 1,20 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

| High Yield Bond (Fortsetzung) | Management- gebühr |
|--|-----------------------|
| Thesaurierende Klasse GBP I | 0,60 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I2 | 0,50 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I2 | 0,50 % |
| Thesaurierende Klasse GBP Z | 0,00 % |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse SEK A | 1,20 % |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse SGD A | 1,20 % |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,20 % |
| Ausschüttende Klasse USD A (Wöchentlich) | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,20 % |
| Ausschüttende Klasse USD A | 1,20 % |
| Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD B | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD C | 0,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 1,20 % |
| Ausschüttende Klasse USD C1 | 1,20 % |
| Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich) | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD C2 | 1,80 % |
| Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD E | 1,80 % |
| Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,60 % |
| Ausschüttende Klasse USD I | 0,60 % |
| Ausschüttende Klasse USD I2 (Monatlich) | 0,50 % |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 0,50 % |
| Ausschüttende Klasse USD I2 | 0,50 % |
| Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich) | 0,36 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 1,20 % |
| Ausschüttende Klasse USD M | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD P | 0,57 % |
| Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) | 1,80 % |
| Ausschüttende Klasse USD T (Wöchentlich) | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD T | 1,80 % |
| Ausschüttende Klasse USD U (Monatlich) | 0,90 % |
| Thesaurierende Klasse USD U | 0,90 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,00 % |
| Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich) | 1,80 % |
| Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich) | 1,80 % |
| Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse ZAR E | 1,80 % |

| High Yield Bond (Fortsetzung) | Management- gebühr |
|---|-----------------------|
| Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse ZAR T | 1,80 % |
| InnovAsia 5G | |
| Thesaurierende Klasse CHF I4 | 0,51 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 1,70 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I4 | 0,51 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | 1,70 % |
| Thesaurierende Klasse EUR X | 1,45 % |
| Thesaurierende Klasse SGD A | 1,70 % |
| Thesaurierende Klasse SGD I4 | 0,51 % |
| Thesaurierende Klasse SGD X | 1,45 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,70 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,85 % |
| Thesaurierende Klasse USD I4 | 0,51 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 1,70 % |
| Thesaurierende Klasse USD X | 1,45 % |
| Japan Equity Engagement | |
| Ausschüttende Klasse EUR I5 | 0,43 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 | 0,43 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert) | 0,43 % |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | 0,81 % |
| Thesaurierende Klasse JPY I | 0,85 % |
| Ausschüttende Klasse JPY I | 0,85 % |
| Thesaurierende Klasse JPY I5 | 0,43 % |
| Thesaurierende Klasse JPY Z | 0,00 % |
| Macro Opportunities FX | |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse GBP Z | 0,00 % |
| Thesaurierende Klasse SEK I | 0,60 % |
| Ausschüttende Klasse SEK I | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,00 % |
| Next Generation Mobility | |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 1,70 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 0,85 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | 0,85 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | 1,70 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,70 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

| Next Generation Mobility (Fortsetzung) | Management- gebühr | Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung) | Management- gebühr |
|--|-------------------------------|--|-------------------------------|
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 1,70 % | Thesaurierende Klasse EUR M | 1,00 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,85 % | Ausschüttende Klasse EUR M | 1,00 % |
| Ausschüttende Klasse USD I | 0,85 % | Thesaurierende Klasse EUR P | 0,48 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 1,70 % | Thesaurierende Klasse EUR U | 0,75 % |
| Thesaurierende Klasse USD X | 1,55 % | Ausschüttende Klasse EUR X | 0,40 % |
| | | Thesaurierende Klasse GBP A | 1,00 % |
| Next Generation Space Economy | | Thesaurierende Klasse GBP I | 0,50 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert) | 0,60 % | Ausschüttende Klasse GBP I | 0,50 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | 1,70 % | Thesaurierende Klasse GBP I2 | 0,40 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,85 % | Ausschüttende Klasse GBP I2 | 0,40 % |
| | | Ausschüttende Klasse GBP I5 | 0,25 % |
| Responsible Asian Debt - Hard Currency | | Thesaurierende Klasse GBP P | 0,48 % |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,20 % | Thesaurierende Klasse JPY I | 0,50 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,20 % | Ausschüttende Klasse JPY I | 0,50 % |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 1,20 % | Thesaurierende Klasse SEK A | 1,00 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,60 % | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 1,00 % |
| Ausschüttende Klasse USD I | 0,60 % | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,00 % |
| Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich) | 0,36 % | Thesaurierende Klasse USD A | 1,00 % |
| Thesaurierende Klasse USD I4 | 0,36 % | Ausschüttende Klasse USD A | 1,00 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 1,20 % | Thesaurierende Klasse USD C1 | 1,00 % |
| Ausschüttende Klasse USD X (Monatlich) | 1,10 % | Ausschüttende Klasse USD C1 | 1,00 % |
| Thesaurierende Klasse USD X | 1,10 % | Thesaurierende Klasse USD I | 0,50 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,00 % | Ausschüttende Klasse USD I | 0,50 % |
| | | Thesaurierende Klasse USD I2 | 0,40 % |
| Short Duration Emerging Market Debt | | Ausschüttende Klasse USD I2 | 0,40 % |
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | 1,00 % | Thesaurierende Klasse USD I5 | 0,25 % |
| Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich) | 1,00 % | Ausschüttende Klasse USD I5 | 0,25 % |
| Thesaurierende Klasse CHF A | 1,00 % | Thesaurierende Klasse USD M | 1,00 % |
| Ausschüttende Klasse CHF A | 1,00 % | Ausschüttende Klasse USD M | 1,00 % |
| Thesaurierende Klasse CHF I | 0,50 % | Thesaurierende Klasse USD P | 0,48 % |
| Ausschüttende Klasse CHF I | 0,50 % | Thesaurierende Klasse USD Z | 0,00 % |
| Thesaurierende Klasse CHF I2 | 0,40 % | | |
| Ausschüttende Klasse CHF I2 | 0,40 % | Short Duration High Yield SDG Engagement | |
| Thesaurierende Klasse CHF I5 | 0,25 % | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse CHF P | 0,48 % | Thesaurierende Klasse CHF A | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 1,00 % | Thesaurierende Klasse CHF I | 0,60 % |
| Ausschüttende Klasse EUR A | 1,00 % | Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 0,50 % | Thesaurierende Klasse EUR A | 1,20 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I | 0,50 % | Ausschüttende Klasse EUR A | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 0,40 % | Thesaurierende Klasse EUR I | 0,60 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I2 | 0,40 % | Thesaurierende Klasse EUR I2 | 0,50 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 0,25 % | Thesaurierende Klasse EUR M | 1,20 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

| Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung) | Managementgebühr |
|--|------------------|
| Ausschüttende Klasse EUR M | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I | 0,60 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I2 | 0,50 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I2 | 0,50 % |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse JPY I | 0,60 % |
| Ausschüttende Klasse JPY I | 0,60 % |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 1,20 % |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,20 % |
| Ausschüttende Klasse USD A | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,60 % |
| Ausschüttende Klasse USD I | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 0,50 % |
| Ausschüttende Klasse USD I2 | 0,50 % |
| Thesaurierende Klasse USD I4 | 0,36 % |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 0,30 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 1,20 % |
| Ausschüttende Klasse USD M | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,00 % |
| Strategic Income | |
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | 1,00 % |
| Ausschüttende Klasse AUD Z (Monatlich) | 0,00 % |
| Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) | 1,00 % |
| Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) | 1,00 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 1,00 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 0,50 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 1,00 % |
| Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich) | 1,00 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I (Monatlich) | 0,50 % |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) | 1,00 % |
| Thesaurierende Klasse JPY I | 0,50 % |
| Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert) | 0,50 % |
| Ausschüttende Klasse JPY I CG | 0,50 % |
| Ausschüttende Klasse JPY I | 0,50 % |
| Thesaurierende Klasse JPY Z | 0,00 % |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 1,00 % |
| Thesaurierende Klasse SGD A | 1,00 % |
| Ausschüttende Klasse SGD I (Monatlich) | 0,50 % |

| Strategic Income (Fortsetzung) | Managementgebühr |
|---|------------------|
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,00 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,00 % |
| Ausschüttende Klasse USD A | 1,00 % |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 1,00 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,50 % |
| Ausschüttende Klasse USD I | 0,50 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 1,00 % |
| Ausschüttende Klasse USD M | 1,00 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,00 % |
| Sustainable Asia High Yield | |
| Thesaurierende Klasse EUR X | 0,40 % |
| Thesaurierende Klasse GBP X | 0,40 % |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,00 % |
| Ausschüttende Klasse USD Z | 0,00 % |
| Sustainable Emerging Market Corporate Debt | |
| Thesaurierende Klasse CHF I | 0,80 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 1,60 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 0,80 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I3 | 0,48 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 1,60 % |
| Ausschüttende Klasse EUR M | 1,60 % |
| Thesaurierende Klasse EUR X | 0,46 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I | 0,80 % |
| Thesaurierende Klasse SEK A | 1,60 % |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,60 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,60 % |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 1,60 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,80 % |
| Ausschüttende Klasse USD I | 0,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 0,64 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 1,60 % |
| Ausschüttende Klasse USD M | 1,60 % |
| Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency | |
| Thesaurierende Klasse EUR I3 | 0,49 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I4 | 0,42 % |
| Thesaurierende Klasse EUR X | 0,35 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

| Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung) | Management-gebühr | Uncorrelated Strategies (Fortsetzung) | Management-gebühr |
|---|--------------------------|--|--------------------------|
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,70 % | Thesaurierende Klasse USD I5 | 0,38 % |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 0,35 % | Thesaurierende Klasse USD M | 1,50 % |
| | | Thesaurierende Klasse USD P | 0,71 % |
| | | Thesaurierende Klasse USD Z | 0,00 % |
| Tactical Macro | | | |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,80 % | US Equity | |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 0,40 % | Thesaurierende Klasse JPY I3 | 0,53 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,00 % | Thesaurierende Klasse USD A | 1,50 % |
| | | Thesaurierende Klasse USD I | 0,75 % |
| Ultra Short Term Euro Bond | | Ausschüttende Klasse USD I | 0,75 % |
| Thesaurierende Klasse CHF P | 0,18 % | Thesaurierende Klasse USD M | 1,50 % |
| Thesaurierende Klasse CHF U | 0,29 % | | |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 0,38 % | US Equity Index PutWrite | |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 0,19 % | Thesaurierende Klasse EUR I | 0,60 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I | 0,19 % | Ausschüttende Klasse EUR I3 | 0,42 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 0,15 % | Thesaurierende Klasse EUR I4 | 0,36 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 0,09 % | Ausschüttende Klasse EUR I4 | 0,36 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 0,38 % | Thesaurierende Klasse EUR M | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse EUR U | 0,29 % | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Z | 0,00 % | Thesaurierende Klasse GBP I3 | 0,42 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,19 % | Ausschüttende Klasse GBP I3 | 0,42 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,00 % | Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert) | 0,42 % |
| | | Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) | 0,36 % |
| Uncorrelated Strategies | | Ausschüttende Klasse GBP I4 | 0,36 % |
| Thesaurierende Klasse CHF I | 0,75 % | Ausschüttende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | 0,57 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 1,50 % | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 0,75 % | Thesaurierende Klasse USD A | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 0,60 % | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 1,50 % | Thesaurierende Klasse USD I | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse EUR P | 0,71 % | Ausschüttende Klasse USD I3 | 0,42 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I | 0,75 % | Thesaurierende Klasse USD I4 | 0,36 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I2 | 0,60 % | Thesaurierende Klasse USD M | 1,20 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I2 | 0,60 % | Thesaurierende Klasse USD Z | 0,00 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 | 0,38 % | | |
| Thesaurierende Klasse GBP P | 0,71 % | US Large Cap Value | |
| Thesaurierende Klasse GBP Z | 0,00 % | Thesaurierende Klasse EUR A | 1,50 % |
| Thesaurierende Klasse JPY I | 0,75 % | Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) | 1,50 % |
| Thesaurierende Klasse SGD A | 1,50 % | Thesaurierende Klasse EUR I | 0,70 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,50 % | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | 0,70 % |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 1,50 % | Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) | 0,42 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,75 % | Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) | 0,35 % |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 0,60 % | | |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

| US Large Cap Value (Fortsetzung) | Management- gebühr | US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung) | Management- gebühr |
|---|-----------------------|--|-----------------------|
| Thesaurierende Klasse GBP I | 0,70 % | Thesaurierende Klasse SGD A | 1,70 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | 0,70 % | Thesaurierende Klasse USD B | 1,80 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I | 0,70 % | Thesaurierende Klasse USD C1 | 1,70 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | 0,70 % | Thesaurierende Klasse USD C2 | 1,80 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) | 0,42 % | Thesaurierende Klasse USD E | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | 0,67 % | Thesaurierende Klasse USD I2 | 0,68 % |
| Ausschüttende Klasse GBP P | 0,67 % | Thesaurierende Klasse USD I3 | 0,50 % |
| Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert) | 0,63 % | Ausschüttende Klasse USD I3 | 0,50 % |
| Ausschüttende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert) | 0,63 % | Thesaurierende Klasse USD M | 1,70 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,50 % | Thesaurierende Klasse USD T | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,70 % | Thesaurierende Klasse USD U | 1,25 % |
| Ausschüttende Klasse USD I4 | 0,42 % | Thesaurierende Klasse USD Z | 0,00 % |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 0,35 % | Thesaurierende Klasse USD1 A | 1,70 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 1,50 % | Thesaurierende Klasse USD1 I | 0,85 % |
| Thesaurierende Klasse USD Y | 0,63 % | Ausschüttende Klasse USD1 I | 0,85 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,00 % | Thesaurierende Klasse ZAR B | 1,80 % |
| | | Thesaurierende Klasse ZAR C2 | 1,80 % |
| | | Thesaurierende Klasse ZAR E | 1,80 % |
| | | Thesaurierende Klasse ZAR T | 1,80 % |
| US Long Short Equity | | US Real Estate Securities | |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 2,25 % | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | 1,50 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 1,35 % | Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I3 | 0,95 % | Thesaurierende Klasse AUD B | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 2,25 % | Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) | 1,80 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I3 | 0,95 % | Thesaurierende Klasse AUD E | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse SGD A1 | 1,80 % | Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD A (PF) | 1,70 % | Thesaurierende Klasse AUD T | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 2,25 % | Thesaurierende Klasse CHF A | 1,50 % |
| Thesaurierende Klasse USD A1 | 1,80 % | Thesaurierende Klasse EUR A | 1,50 % |
| Ausschüttende Klasse USD I (PF) | 1,00 % | Thesaurierende Klasse EUR I | 0,75 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 1,35 % | Thesaurierende Klasse EUR M | 1,50 % |
| Thesaurierende Klasse USD I3 | 0,95 % | Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) | 1,50 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 2,25 % | Thesaurierende Klasse SGD A | 1,50 % |
| Thesaurierende Klasse USD U | 1,80 % | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,50 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,00 % | Thesaurierende Klasse USD A | 1,50 % |
| | | Ausschüttende Klasse USD A | 1,50 % |
| US Multi Cap Opportunities | | Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse AUD E | 1,80 % | Thesaurierende Klasse USD B | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse AUD T | 1,80 % | Thesaurierende Klasse USD C1 | 1,50 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I3 | 0,50 % | Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 1,70 % | Thesaurierende Klasse USD E | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse EUR1 A | 1,70 % | | |
| Thesaurierende Klasse EUR1 I | 0,85 % | | |
| Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert) | 0,50 % | | |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

| US Real Estate Securities (Fortsetzung) | Management- gebühr | US Small Cap (Fortsetzung) | Management- gebühr |
|--|-----------------------|--|-----------------------|
| Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) | 0,75 % | Thesaurierende Klasse ZAR T | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,75 % | | |
| Ausschüttende Klasse USD I | 0,75 % | US Small Cap Intrinsic Value | |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 0,54 % | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | 0,85 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 1,50 % | Thesaurierende Klasse GBP I2 (nicht währungsgesichert) | 0,68 % |
| Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) | 1,80 % | Thesaurierende Klasse JPY I3 (nicht währungsgesichert) | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse USD T | 1,80 % | Thesaurierende Klasse USD A | 1,70 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,00 % | Thesaurierende Klasse USD I | 0,85 % |
| Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich) | 1,80 % | Thesaurierende Klasse USD I2 | 0,68 % |
| Thesaurierende Klasse ZAR B | 1,80 % | Thesaurierende Klasse USD M | 1,70 % |
| Thesaurierende Klasse ZAR C2 | 1,80 % | | |
| Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) | 1,80 % | | |
| Thesaurierende Klasse ZAR E | 1,80 % | | |
| Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) | 1,80 % | | |
| Thesaurierende Klasse ZAR T | 1,80 % | | |
| | | | |
| US Small Cap | | | |
| Thesaurierende Klasse AUD B | 1,80 % | | |
| Thesaurierende Klasse AUD C2 | 1,80 % | | |
| Thesaurierende Klasse AUD E | 1,80 % | | |
| Thesaurierende Klasse AUD T | 1,80 % | | |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 1,70 % | | |
| Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) | 1,70 % | | |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 0,85 % | | |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | 0,85 % | | |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert) | 0,68 % | | |
| Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) | 0,51 % | | |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 1,70 % | | |
| Thesaurierende Klasse EUR Z | 0,00 % | | |
| Ausschüttende Klasse JPY I | 0,85 % | | |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,70 % | | |
| Ausschüttende Klasse USD A | 1,70 % | | |
| Thesaurierende Klasse USD B | 1,80 % | | |
| Thesaurierende Klasse USD C2 | 1,80 % | | |
| Thesaurierende Klasse USD E | 1,80 % | | |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,85 % | | |
| Ausschüttende Klasse USD I | 0,85 % | | |
| Thesaurierende Klasse USD I3 | 0,60 % | | |
| Thesaurierende Klasse USD M | 1,70 % | | |
| Thesaurierende Klasse USD T | 1,80 % | | |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,00 % | | |
| Thesaurierende Klasse ZAR E | 1,80 % | | |

Gegebenenfalls wird auf die o. g. Gebühren ein Rabatt eingeräumt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

Der Manager kann auf seine Gebühren verzichten, um die Gesamtkostenquoten („TERs“) der Portfolios nach oben zu begrenzen. Diese Gebührenverzichtete sind freiwillig und können vom Manager jederzeit ohne vorherige Mitteilung zurückgenommen werden. Gebühren, auf die freiwillig verzichtet wurde, können nicht vom Manager zurückgefordert werden. Eine Aufgliederung der TERs der einzelnen Portfolios ist in Anhang I enthalten.

Die Gesellschaft bezahlt Verwaltungsgebühren, die nicht mehr als 0,20 % des NIW des betreffenden Portfolios betragen werden. Die Verwaltungsgebühr setzt sich zusammen aus einer Gebühr, die an die Verwaltungsstelle für die von ihr in Bezug auf jedes Portfolio erbrachten Verwaltungsdienste zu zahlen ist, und einer Gebühr, die an den Manager für die von ihm für jedes Portfolio erbrachten administrativen Supportdienste zu zahlen ist; sie läuft monatlich auf und ist monatlich rückwirkend zu zahlen.

Der Fonds zahlt/zahlte an die Verwaltungsstelle Verwaltungsgebühren auf der Grundlage der Bewertung des Nettovermögens des Uncorrelated Strategies und Uncorrelated Trading am Monatsende mit den folgenden Sätzen:

| | |
|--|---------|
| Vermögenswerte von 0 – 500 Mio. US\$ | 0,055 % |
| Vermögenswerte von 500 – 2.000 Mio. US\$ | 0,05 % |
| Vermögenswerte über 2.000 Mio. US\$ | 0,04 % |

Der Fonds zahlt an die Verwaltungsstelle Verwaltungsgebühren auf der Grundlage des Nettoinventarwertes am Monatsende, und zwar für jedes von der Verwaltungsstelle verwaltete Portfolio und mit den folgenden Sätzen:

| | |
|---|---------|
| Vermögenswerte von 0 – 25.000 Mio. US\$ | 0,008 % |
| Vermögenswerte über 25.000 Mio. US\$ | 0,005 % |

Die oben genannten Gebühren unterliegen einer monatlichen Mindestgebühr von 4.000 US\$ pro Portfolio und umfassen vier Anteilklassen pro Portfolio. Bei Portfolios, die mehr als vier Anteilklassen haben, wird für jede zusätzliche Anteilklasse eine monatliche Gebühr von 150 US\$ erhoben.

Darüber hinaus hat die Verwaltungsstelle Anspruch auf eine weitere Gebühr in Bezug auf die Transferstellendienste, die sie für das Portfolio erbringt.

In Bezug auf Anteile der Klassen B, C, E, C1 und C2 des jeweiligen Portfolios hat/haben der Manager und/oder die betreffende Vertriebsstelle für ihre Vertriebsdienstleistungen, die er/sie für diese Klassen erbringt/erbringen, Anspruch auf eine Vertriebsgebühr zu einem jährlichen Satz von 1,00 % des NIW der betreffenden Klassen. Diese wird taggenau berechnet und monatlich rückwirkend am Ende eines jeden Kalendermonats gezahlt. In Bezug auf Anteile der Klasse M des jeweiligen Portfolios hat/haben der Manager und/oder die betreffende Vertriebsstelle für seine/ihre Vertriebsdienstleistungen, die er/sie für diese Klassen erbringt/erbringen, Anspruch auf eine Vertriebsgebühr zu einem jährlichen Satz in Höhe eines Prozentsatzes des NIW der jeweiligen Klasse. Diese wird taggenau berechnet und monatlich rückwirkend am Ende eines jeden Kalendermonats gezahlt. Der Satz für diese Vertriebsgebühr variiert zwischen den Portfolios und ist im Nachtrag für die einzelnen Portfolios aufgeführt. In Bezug auf alle anderen Klassen kann der Manager der Vertriebsstelle für ihre Vertriebsdienste eine Gebühr (zu normalen kommerziellen Sätzen) zahlen, die ebenfalls durch Managementgebühr abgedeckt wird.

Gebühren der nicht verbundenen Unterberater

Die an die vom Manager und/oder Sub-Investment-Manager ernannten nicht verbundenen Unterberater gezahlten Gebühren werden mit Ausnahme der Green Court Capital Management Limited und den Unterberatern zu Uncorrelated Strategies aus dem Portfoliovermögen bestritten. Die insgesamt an alle Berater gezahlten Gebühren lagen zwischen 0,65 % und 1,50 % des NIW des Portfolios. Die aggregierten Beratungsgebühren für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 betragen 1.145.544 US\$ (31. Dezember 2022: 1.622.785 US\$).

Erfolgsabhängige Gebühren

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wird eine erfolgsabhängige Gebühr für den US Long Short Equity, den Global High Yield SDG Engagement, den Event Driven, den Tactical Macro, den Uncorrelated Strategies und den Uncorrelated Trading berechnet.

An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr

Der Manager und ein Sub-Investment-Manager haben unter Umständen Anspruch auf eine erfolgsabhängige Gebühr (die „erfolgsabhängige Gebühr“) die aus dem Portfoliovermögen in Bezug auf jede PF-Klasse des betreffenden Portfolios zahlbar ist. Die Verwahrstelle überprüft die Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr. Die Direktoren können mit Zustimmung des Managers die erfolgsabhängige Gebühr, die von einer Anteilklasse zu zahlen ist, reduzieren. Erfolgsabhängige Gebühren fallen auf realisierte und nicht realisierte Kapitalerträge unter Berücksichtigung der realisierten und nicht realisierten Verluste zum Ende des unten für jedes Portfolio definierten Berechnungszeitraums an. Daher können erfolgsabhängige Gebühren auf nicht realisierte Gewinne gezahlt werden, die in der Folge niemals realisiert werden.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR**6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)****Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)***An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)*

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass die erfolgsabhängige Gebühr auf Anteilklassenebene und nicht auf Ebene des individuellen Anteilinhabers berechnet wird und Anteilinhabern somit eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt werden kann, auch wenn der NIW ihrer Anteile gleichgeblieben oder zurückgegangen ist. Dies ist unter Umständen der Fall, wenn Anteilinhaber Anteile zu einem Zeitpunkt kaufen oder verkaufen, bei dem es sich nicht um den Beginn oder das Ende des Berechnungszeitraums handelt.

Wird der Managementvertrag in einem beliebigen Jahr vor Ende des Berechnungszeitraums beendet oder dem Sub-Investment-Manager gekündigt, dann wird die erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf den laufenden Berechnungszeitraum so berechnet und ausbezahlt, als ob das Datum, zu dem dieser Vertrag beendet wird, dem Ende des betreffenden Berechnungszeitraums entspräche.

Die erfolgsabhängige Gebühr läuft an jedem Handelstag im NIW auf und ist gewöhnlich an den Manager oder einen Sub-Investment-Manager rückwirkend innerhalb von 30 Geschäftstagen am Ende eines jeden Berechnungszeitraums zu zahlen. Im Falle von während des Berechnungszeitraums zurückgenommenen Anteilen ist die aufgelaufene erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf diese Anteile jedoch an den Manager oder einen Sub-Investment-Manager innerhalb von 30 Geschäftstagen des Rücknahmedatums zahlbar. Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren verbleiben in der betreffenden Klasse (partizipieren jedoch nicht an darauffolgenden Gewinnen und Verlusten der betreffenden Klasse), bis sie an den Manager oder einen Sub-Investment-Manager gezahlt werden, und werden nicht zur Bedienung von Rücknahmeanträgen oder zur Zahlung von Gebühren und Aufwendungen der betreffenden Klasse herangezogen oder zur Verfügung gestellt.

Die zur Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr verwendete Methode für jedes betreffende Portfolio gestaltet sich wie folgt:

US Long Short Equity

Der Manager hat unter Umständen Anspruch auf eine erfolgsabhängige Gebühr, die aus dem Portfoliovermögen in Bezug auf jede PF-Klasse des betreffenden Portfolios zahlbar ist.

Definitionen

| | |
|-------------------------------|---|
| Berechnungszeitraum | <p>Der Berechnungszeitraum geht normalerweise jährlich vom 1. Januar bis zum 31. Dezember, mit Ausnahme, dass:</p> <ul style="list-style-type: none"> im Fall der Erstausgabe von Anteilen in jeder PF-Klasse der erste Berechnungszeitraum vom Ausgabedatum bis zum 31. Dezember geht; im Fall der Auflösung einer PF-Klasse der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet; und im Fall der Auflösung des Managementvertrags während eines Jahres der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet. <p>Der erste Wert, auf dessen Grundlage die erste erfolgsabhängige Gebühr für alle PF-Klassen ermittelt wird, ist der Erstangebotspreis.</p> |
| Festlegung (Kristallisierung) | Der Punkt, an dem eine erfolgsabhängige Gebühr an den Manager zahlbar wird. Die Festlegung erfolgt entweder am Ende des Berechnungszeitraums oder an einem Handelstag, an dem ein Anteilinhaber den gesamten oder einen Teil seines Anteilsbestands zurückgibt oder umtauscht. |
| High Water Mark (Höchstmarke) | Ist entweder (i) der Erstangebotspreis je Anteil oder (ii) der NIW je Anteil am Ende des vorherigen Berechnungszeitraums, in Bezug auf den eine erfolgsabhängige Gebühr gezahlt wurde, je nachdem, welcher Wert höher ist. |

Methode

Für jeden Berechnungszeitraum wird eine erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf jede im Umlauf befindliche PF-Klasse fällig, wenn der NIW je Anteil am Ende des Berechnungszeitraums die High Water Mark für diese spezielle PF-Klasse übersteigt.

Die erfolgsabhängige Gebühr wird an jedem Handelstag berechnet und entspricht 15 % des Betrags, um den das prozentuale Wachstum im NIW je Anteil im Berechnungszeitraum das der High Water Mark übersteigt. Die erfolgsabhängige Gebühr läuft an jedem Handelstag auf und bildet Teil des NIW je Anteil für jede PF-Klasse, wo zutreffend. Jede an einem Handelstag aufgelaufene erfolgsabhängige Gebühr wird von einem am folgenden Handelstag erfolgten Zuwachs bis zum letzten Handelstag des Berechnungszeitraums ersetzt.

In allen Fällen erfolgte beim zur Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr angewandten NIW je Anteil keine vorherige Verwässerungsanpassung, d. h. er enthält keine Swing-Pricing-Anpassung.

Eine erfolgsabhängige Gebühr wird erst gezahlt, wenn der NIW je Anteil die High Water Mark überschreitet, und derlei Gebühr wird nur bei einer Outperformance des über die Hurdle Rate (Mindestrendite) hinausgehenden NIW je Anteil, wie vorstehend beschrieben, zahlbar.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)

An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)

US Long Short Equity (Fortsetzung)

Methode (Fortsetzung)

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass die erfolgsabhängige Gebühr auf Anteilklassenebene und nicht auf Ebene des individuellen Anteilinhabers berechnet wird und ihnen daher eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt werden kann, auch wenn der NIW ihrer Anteile gleichgeblieben oder zurückgegangen ist. Dies ist unter Umständen der Fall, wenn Anteilinhaber Anteile zu einem Zeitpunkt kaufen oder verkaufen, bei dem es sich nicht um den Beginn oder das Ende des Berechnungszeitraums handelt.

Die erfolgsabhängige Gebühr läuft an jedem Handelstag im NIW auf und ist gewöhnlich an den Manager rückwirkend innerhalb von 30 Geschäftstagen am Ende eines jeden Berechnungszeitraums zu zahlen. Im Falle von während des Berechnungszeitraums zurückgenommenen Anteilen ist die aufgelaufene erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf diese Anteile jedoch an den Manager innerhalb von 30 Geschäftstagen des Rücknahmedatums zahlbar.

Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren verbleiben in der betreffenden PF-Klasse (partizipieren jedoch nicht an darauffolgenden Gewinnen und Verlusten der betreffenden Klasse), bis sie an den Manager gezahlt werden, und werden nicht zur Bedienung von Rücknahmeanträgen oder zur Zahlung von Gebühren und Aufwendungen der betreffenden PF-Klasse herangezogen oder zur Verfügung gestellt.

Die Verwahrstelle überprüft die Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr.

Die Direktoren können mit Zustimmung des Managers die erfolgsabhängige Gebühr, die von einer PF-Klasse zu zahlen ist, reduzieren. Erfolgsabhängige Gebühren fallen auf realisierte und nicht realisierte Kapitalerträge (zur Klarstellung: einschließlich Anlageerträgen) unter Berücksichtigung der realisierten und nicht realisierten Verluste zum Ende des Berechnungszeitraums an. Daher können erfolgsabhängige Gebühren auf nicht realisierte Gewinne gezahlt werden, die in der Folge niemals realisiert werden.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 verdiente der Manager eine erfolgsabhängige Gebühr in Höhe von 284.324 US\$ (31. Dezember 2022: null USD).

Global High Yield SDG Engagement

Der Manager hat unter Umständen Anspruch auf eine erfolgsabhängige Gebühr, die aus dem Portfoliovermögen in Bezug auf jede PF-Klasse des betreffenden Portfolios zahlbar ist.

Definitionen

| | |
|-------------------------------|---|
| Benchmark | ICE BofA Global High Yield Constrained Index in der entsprechenden Klassenwährung (wie nachstehend beschrieben) |
| Berechnungszeitraum | Der Berechnungszeitraum geht normalerweise jährlich vom 1. Januar bis zum 31. Dezember, mit Ausnahme, dass: <ul style="list-style-type: none"> • im Fall der Erstausgabe von Anteilen in jeder PF-Klasse der erste Berechnungszeitraum vom Ausgabedatum bis zum 31. Dezember geht; • im Fall der Auflösung einer PF-Klasse der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet; und • im Fall der Auflösung des Managementvertrags während eines Jahres der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet. Der erste Wert, auf dessen Grundlage die erste erfolgsabhängige Gebühr für alle PF-Klassen ermittelt wird, ist der Erstangebotspreis. |
| Festlegung (Kristallisierung) | Der Punkt, an dem eine nicht ausgleichende erfolgsabhängige Gebühr an den Manager zahlbar wird. Die Festlegung erfolgt entweder am Ende des Berechnungszeitraums oder an einem Handelstag, an dem ein Anteilinhaber den gesamten oder einen Teil seines Anteilsbestands zurückgibt oder umwandelt. |
| Outperformance | Die überdurchschnittlich positive Entwicklung des NIW je Anteil über der Performance der Benchmark im Berechnungszeitraum. |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR**6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)****Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)**

An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)

Global High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)Methode

Für jeden Berechnungszeitraum wird eine erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf jede im Umlauf befindliche PF-Klasse bei einer Outperformance, d. h. einer überdurchschnittlich positiven Entwicklung des NIW je Anteil gegenüber der Performance der für diese spezielle PF-Klasse im Berechnungszeitraum geltenden Benchmark, fällig. Die prozentuale Gebühr wird an jedem Handelstag berechnet und entspricht 20 % der für diese spezielle PF-Klasse im selben Zeitraum geltenden Outperformance.

In allen Fällen erfolgte beim zur Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr angewandten NIW je Anteil keine vorherige Verwässerungsanpassung, d. h. er enthält keine Swing-Pricing-Anpassung.

Für den Fall, dass die Performance einer PF-Klasse über einen Berechnungszeitraum geringer ist als die der Benchmark, fällt in Bezug auf diese PF-Klasse keine erfolgsabhängige Gebühr an, bis eine solche kumulative Underperformance gegenüber ihrer Benchmark hereingeholt wurde.

Im Fall, dass die PF-Klasse eine Outperformance in einem Berechnungszeitraum erzielt hat, wird eine erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf diese PF-Klasse zahlbar. Nach der Zahlung wird die Benchmark angepasst, dieser Prozess gewährleistet, dass der NIW je Anteil und die Benchmark zu Beginn des Berechnungszeitraums von derselben Stelle ausgehen. Folglich entspricht der anfängliche Benchmark-Wert für den nächsten Berechnungszeitraum dem NIW in Bezug auf die PF-Klasse, für die die erfolgsabhängige Gebühr gezahlt wurde, d. h., wenn der NIW 110 entsprechen würde, läge der Benchmark-Wert ebenfalls bei 110.

Benchmarkindizes

| Klassen | Index | Code |
|-----------------------------|---|------------------------------|
| USD PF-Klassen: | ICE BofA Global High Yield Constrained Index | HWOC ausgewählte Währung USD |
| Abgesicherte PF-Klassen EUR | ICE BofA Global High Yield Constrained Index – in EUR abgesichert | HWOC ausgewählte Währung EUR |
| Abgesicherte PF-Klassen GBP | ICE BofA Global High Yield Constrained Index – in GBP abgesichert | HWOC ausgewählte Währung GBP |

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass im Falle einer zahlbaren erfolgsabhängigen Gebühr auf die Outperformance gegenüber der Benchmark ihnen auch dann eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt wird, wenn der NIW ihrer Anteile zurückgegangen ist, allerdings in einem geringeren Ausmaß als die Benchmark.

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass die erfolgsabhängige Gebühr auf Anteilklassenebene und nicht auf Ebene des individuellen Anteilinhabers berechnet wird und ihnen daher eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt werden kann, auch wenn der NIW ihrer Anteile gleichgeblieben oder zurückgegangen ist. Dies ist unter Umständen der Fall, wenn Anteilinhaber Anteile zu einem Zeitpunkt kaufen oder verkaufen, bei dem es sich nicht um den Beginn oder das Ende eines Berechnungszeitraums handelt.

Die erfolgsabhängige Gebühr läuft an jedem Handelstag im NIW auf und ist gewöhnlich an den Manager rückwirkend innerhalb von 30 Geschäftstagen am Ende eines jeden Berechnungszeitraums zu zahlen. Im Falle von während des Berechnungszeitraums zurückgenommenen Anteilen ist die aufgelaufene erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf diese Anteile jedoch an den Manager innerhalb von 30 Geschäftstagen des Rücknahmedatums zahlbar.

Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren verbleiben in der betreffenden PF-Klasse (partizipieren jedoch nicht an darauffolgenden Gewinnen und Verlusten der betreffenden Klasse), bis sie an den Manager gezahlt werden, und werden nicht zur Bedienung von Rücknahmeanträgen oder zur Zahlung von Gebühren und Aufwendungen der betreffenden PF-Klasse herangezogen oder zur Verfügung gestellt.

Die Verwahrstelle überprüft die Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr.

Die Direktoren können mit Zustimmung des Managers die erfolgsabhängige Gebühr, die von einer PF-Klasse zu zahlen ist, reduzieren. Erfolgsabhängige Gebühren fallen auf realisierte und nicht realisierte Kapitalerträge (zur Klarstellung: einschließlich Anlageerträgen) unter Berücksichtigung der realisierten und nicht realisierten Verluste zum Ende des Berechnungszeitraums an. Daher können erfolgsabhängige Gebühren auf nicht realisierte Gewinne gezahlt werden, die in der Folge niemals realisiert werden.

Für die Geschäftsjahre zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 wurden vom Portfolio keine erfolgsabhängigen Gebühren an den Manager gezahlt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)

An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)

Event Driven

Der Manager hat unter Umständen Anspruch auf eine erfolgsabhängige Gebühr, die aus dem Portfoliovermögen in Bezug auf jede PF-Klasse des betreffenden Portfolios zahlbar ist. Alle Anteilkassen im Portfolio sind PF-Klassen.

Definitionen

| | |
|-------------------------------|--|
| Berechnungszeitraum | <p>Der Berechnungszeitraum geht normalerweise jährlich vom 1. Januar bis zum 31. Dezember, mit Ausnahme, dass:</p> <ul style="list-style-type: none"> • im Fall der Erstaussgabe von Anteilen in jeder PF-Klasse der erste Berechnungszeitraum vom Ausgabedatum bis zum 31. Dezember geht; • im Fall der Auflösung einer PF-Klasse der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet; und • im Fall der Auflösung des Managementvertrags während eines Jahres der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet. <p>Der erste Wert, auf dessen Grundlage die erste erfolgsabhängige Gebühr für alle PF-Klassen ermittelt wird, ist der Erstangebotspreis.</p> |
| Festlegung (Kristallisierung) | <p>Der Punkt, an dem eine erfolgsabhängige Gebühr an den Manager zahlbar wird. Die Festlegung erfolgt entweder am Ende des Berechnungszeitraums oder an einem Handelstag, an dem ein Anteilinhaber den gesamten oder einen Teil seines Anteilsbestands zurückgibt oder umtauscht.</p> |
| High Water Mark (Höchstmarke) | <p>Ist entweder (i) der Erstangebotspreis je Anteil oder (ii) der NIW je Anteil am Ende des vorherigen Berechnungszeitraums, in Bezug auf den eine erfolgsabhängige Gebühr gezahlt wurde, je nachdem, welcher Wert höher ist.</p> |

Methode

Für jeden Berechnungszeitraum wird eine erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf jede im Umlauf befindliche PF-Klasse fällig, wenn der NIW je Anteil am Ende des Berechnungszeitraums die High Water Mark (nach Abzug aller Kosten vor dem Abzug einer aufgelaufenen erfolgsabhängigen Gebühr, sofern dies im besten Interesse des Anteilinhabers liegt) für diese spezielle PF-Klasse übersteigt.

Die erfolgsabhängige Gebühr wird an jedem Handelstag berechnet und entspricht 15 % des Betrags, um den das prozentuale Wachstum im Nettoinventarwert je Anteil im Berechnungszeitraum das der High Water Mark übersteigt, mit Ausnahme der Klassen I5, für die die erfolgsabhängige Gebühr 15 % des Betrags, um den das prozentuale Wachstum im Nettoinventarwert je Anteil im Berechnungszeitraum das der High Water Mark übersteigt, entspricht.

Die erfolgsabhängige Gebühr läuft an jedem Handelstag auf und bildet Teil des Nettoinventarwerts je Anteil für jede PF-Klasse, wo zutreffend. Jede an einem Handelstag aufgelaufene erfolgsabhängige Gebühr wird von einem am folgenden Handelstag erfolgten Zuwachs bis zum letzten Handelstag des Berechnungszeitraums ersetzt.

In allen Fällen erfolgte beim zur Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr angewandten Nettoinventarwert je Anteil keine vorherige Verwässerungsanpassung, d. h. er enthält keine Swing-Pricing-Anpassung.

Es wird keine erfolgsabhängige Gebühr gezahlt, wenn der Nettoinventarwert je Anteil die High Water Mark überschreitet, und derlei Gebühr wird nur bei einer Outperformance des über die High Water Mark hinausgehenden Nettoinventarwerts je Anteil, wie vorstehend beschrieben, zahlbar.

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass die erfolgsabhängige Gebühr auf Anteilklassenebene und nicht auf Ebene des individuellen Anteilinhabers berechnet wird und ihnen daher unter Umständen eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt wird, selbst wenn der Nettoinventarwert ihrer Anteile gleich geblieben oder zurückgegangen ist, zum Beispiel, wenn Anteilinhaber Anteile zu einem Zeitpunkt kaufen oder verkaufen, bei dem es sich nicht um den Beginn oder das Ende des Berechnungszeitraums handelt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)

An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)

Event Driven (Fortsetzung)

Methode (Fortsetzung)

Die erfolgsabhängige Gebühr läuft an jedem Handelstag im Nettoinventarwert auf und ist gewöhnlich an den Manager rückwirkend innerhalb von 30 Geschäftstagen am Ende eines jeden Berechnungszeitraums zu zahlen. Im Falle von während des Berechnungszeitraums zurückgenommenen Anteilen ist die aufgelaufene erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf diese Anteile jedoch an den Manager innerhalb von 30 Geschäftstagen des Rücknahmedatums zahlbar.

Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren verbleiben in der betreffenden PF-Klasse (partizipieren jedoch nicht an darauffolgenden Gewinnen und Verlusten der betreffenden Klasse), bis sie an den Manager gezahlt werden, und werden nicht zur Bedienung von Rücknahmeanträgen oder zur Zahlung von Gebühren und Aufwendungen der betreffenden PF-Klasse herangezogen oder zur Verfügung gestellt.

Die Verwahrstelle prüft die Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr und stellt sicher, dass sie nicht manipuliert werden kann.

Die Direktoren können mit Zustimmung des Managers die erfolgsabhängige Gebühr, die von einer PF-Klasse zu zahlen ist, reduzieren. Erfolgsabhängige Gebühren fallen auf realisierte und nicht realisierte Kapitalerträge (zur Klarstellung: einschließlich Anlageerträgen) unter Berücksichtigung der realisierten und nicht realisierten Verluste zum Ende des Berechnungszeitraums an. Daher können erfolgsabhängige Gebühren auf nicht realisierte Gewinne gezahlt werden, die in der Folge niemals realisiert werden.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 verdiente der Manager eine erfolgsabhängige Gebühr in Höhe von 1.269.230 US\$ (31. Dezember 2022: 89.185 US\$).

Tactical Macro

Der Sub-Investment-Manager hat unter Umständen Anspruch auf eine erfolgsabhängige Gebühr, die aus dem Portfoliovermögen in Bezug auf jede PF-Klasse des betreffenden Portfolios zahlbar ist. Alle Anteilkassen im Portfolio sind PF-Klassen.

Definitionen

| | |
|-------------------------------|--|
| Berechnungszeitraum | <p>Der Berechnungszeitraum geht normalerweise jährlich vom 1. Januar bis zum 31. Dezember, mit Ausnahme, dass:</p> <ul style="list-style-type: none"> im Fall der Erstausgabe von Anteilen in jeder Klasse der erste Berechnungszeitraum vom Ausgabedatum bis zum 31. Dezember des folgenden Jahres geht; im Fall der Auflösung einer Klasse der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet; und im Fall der Auflösung des Vertrags des Sub-Investment-Managers während eines Jahres, der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet. |
| Festlegung (Kristallisierung) | <p>Der Punkt, an dem eine erfolgsabhängige Gebühr an den Sub-Investment-Manager zahlbar wird. Die Festlegung erfolgt entweder (i) am Ende des Berechnungszeitraums, (ii) bei Beendigung der Bestellung des Sub-Investment-Managers oder (iii) an einem Handelstag, an dem ein Anteilinhaber den gesamten oder einen Teil seines Anteilsbestands zurückgibt oder umtauscht.</p> |
| Outperformance | <p>Die überdurchschnittlich positive Entwicklung des Nettoinventarwerts je Anteil über der Performance der Benchmark im Berechnungszeitraum.</p> |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)

An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)

Tactical Macro (Fortsetzung)

Benchmarkindizes

| Klassen | Index |
|--------------------------|---|
| USD-Klassen | ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return, USD) |
| Abgesicherte Klassen EUR | ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return - EUR Hedged) |
| Abgesicherte Klassen GBP | ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return - GBP Hedged) |
| Abgesicherte Klassen CHF | ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return - CHF Hedged) |
| Abgesicherte Klassen JPY | ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return - JPY Hedged) |

Die Benchmark ist ein weit verbreiteter Richtwert für kurzfristige Zinssätze, der einen Anhaltspunkt für die Durchschnittskurse liefert, zu denen Banken für bestimmte Zeiträume in bestimmten Währungen ungesicherte Interbankkredite aufnehmen können.

Für Klassen, die in anderen als die oben genannten Währungen denominiert sind, wird der ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return, USD) die Benchmark sein. Der Index ist gegenüber der jeweiligen Klassenwährung abgesichert und stellt für die Anleger dieser Klassen eine besser geeignete Vergleichsgröße dar.

Methode

Für jeden Berechnungszeitraum wird bzgl. jeder ausgegebenen Klasse eine erfolgsabhängige Gebühr für eine Outperformance fällig, d. h. die überdurchschnittlich positive Wertentwicklung des Nettoinventarwerts je Anteil (nach Abzug aller Kosten vor dem Abzug einer aufgelaufenen erfolgsabhängigen Gebühr, sofern dies im besten Interesse des Anteilinhabers liegt) gegenüber der Wertentwicklung der für die jeweilige Klasse geltenden Benchmark während des Berechnungszeitraums. Die erfolgsabhängige Gebühr wird an jedem Handelstag berechnet und entspricht bis zu 20 % der für diese spezielle Klasse im selben Zeitraum geltenden Outperformance.

Für den Fall, dass die Performance einer Klasse über einen Berechnungszeitraum geringer ist als die der Benchmark, fällt in Bezug auf diese Klasse keine erfolgsabhängige Gebühr an, bis eine solche kumulative Underperformance gegenüber ihrer Benchmark hereingeholt wurde.

Im Fall, dass die Klasse eine Outperformance in einem Berechnungszeitraum erzielt hat, wird eine erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf diese Klasse zahlbar. Nach der Zahlung wird die Benchmark angepasst, dieser Prozess gewährleistet, dass der Nettoinventarwert je Anteil und die Benchmark zu Beginn des Berechnungszeitraums von derselben Stelle ausgehen. Folglich entspricht der anfängliche Benchmarkwert für den nächsten Berechnungszeitraum dem Nettoinventarwert in Bezug auf die Klasse, für die die erfolgsabhängige Gebühr gezahlt wurde, d. h. wenn der Nettoinventarwert am Ende eines Berechnungszeitraums, in dem eine erfolgsabhängige Gebühr gezahlt wurde, 110 betragen würde, würde der Benchmarkwert zu Beginn des folgenden Berechnungszeitraums ebenfalls 110 betragen.

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass im Falle einer zahlbaren erfolgsabhängigen Gebühr auf die Outperformance gegenüber der Benchmark ihnen auch dann eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt wird, wenn der Nettoinventarwert je Anteil zurückgegangen ist, allerdings in einem geringeren Ausmaß als die Benchmark.

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass die erfolgsabhängige Gebühr auf Anteilklassenebene und nicht auf Ebene des individuellen Anteilinhabers berechnet wird, und da in Bezug auf die erfolgsabhängige Gebühr kein Series Accounting Anwendung findet ihnen daher unter Umständen eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt wird, selbst wenn der Nettoinventarwert ihrer Anteile gleich geblieben oder zurückgegangen ist, zum Beispiel, wenn Anteilinhaber Anteile zu einem Zeitpunkt kaufen oder verkaufen, bei dem es sich nicht um den Beginn oder das Ende des Berechnungszeitraums handelt.

Die erfolgsabhängige Gebühr wird täglich zu jedem Bewertungszeitpunkt ermittelt und läuft zu diesem auf. Die erfolgsabhängige Gebühr wird auf den nicht für eine Verwässerungsgebühr angepassten Nettoinventarwert je Anteil berechnet, d. h. bevor eine Swing-Pricing-Anpassung erfolgte (weitere Informationen in Bezug auf „Swing Pricing“ sind im Abschnitt „Ermittlung des Nettoinventarwerts – Bewertungsanpassungen und Swing Pricing“ des Verkaufsprospekts enthalten).

Die erfolgsabhängige Gebühr wird gewöhnlich rückwirkend innerhalb von 30 Geschäftstagen nach dem 31. Dezember jeden Jahres an den Sub-Investment-Manager gezahlt. Für den Fall der Feststellung einer erfolgsabhängigen Gebühr während eines Berechnungszeitraums wird die aufgelaufene erfolgsabhängige Gebühr für solche Beträge innerhalb von 30 Geschäftstagen nach Ende des Kalenderquartals zahlbar, in dem die Feststellung erfolgte.

Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren verbleiben im Portfolio, bis sie an den Sub-Investment-Manager gezahlt werden, und partizipieren nicht an darauffolgenden Gewinnen oder Verlusten des Portfolios. Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren werden nicht zur Bedienung von Rücknahmeanträgen oder zur Zahlung von Gebühren und Aufwendungen des Portfolios oder des Fonds (außer den an den Sub-Investment-Manager zahlbaren Gebühren) herangezogen oder zu Verfügung gestellt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR**6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)****Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)**

An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)

Tactical Macro (Fortsetzung)Methode (Fortsetzung)

Die Verwahrstelle prüft die Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr und stellt sicher, dass sie nicht manipuliert werden kann.

Erfolgsabhängige Gebühren fallen auf realisierte und nicht realisierte Kapitalerträge (zur Klarstellung: einschließlich Anlageerträgen) unter Berücksichtigung der realisierten und nicht realisierten Verluste zum Ende des Berechnungszeitraums an. Daher können erfolgsabhängige Gebühren auf nicht realisierte Gewinne gezahlt werden, die in der Folge niemals realisiert werden.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden vom Portfolio keine erfolgsabhängigen Gebühren an den Sub-Investment-Manager gezahlt.

Uncorrelated Strategies

Der Sub-Investment-Manager hat unter Umständen Anspruch auf eine erfolgsabhängige Gebühr, die aus dem Portfoliovermögen in Bezug auf jede PF-Klasse des betreffenden Portfolios zahlbar ist. Alle Anteilkassen im Portfolio sind PF-Klassen.

Definitionen

| | |
|-------------------------------|--|
| Berechnungszeitraum | <p>Der Berechnungszeitraum geht normalerweise jährlich vom 1. Januar bis zum 31. Dezember, mit Ausnahme, dass:</p> <ul style="list-style-type: none"> • im Fall der Erstausgabe von Anteilen in jeder Klasse der erste Berechnungszeitraum vom Ausgabedatum bis zum 31. Dezember des folgenden Jahres geht; • im Fall der Auflösung einer Klasse der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet; und • im Fall der Auflösung des Vertrags des Sub-Investment-Managers während eines Jahres, der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet. |
| Festlegung (Kristallisierung) | <p>Der Punkt, an dem eine erfolgsabhängige Gebühr an den Sub-Investment-Manager zahlbar wird. Die Festlegung erfolgt entweder (i) am Ende des Berechnungszeitraums, (ii) bei Beendigung der Bestellung des Sub-Investment-Managers oder (iii) an einem Handelstag, an dem ein Anteilinhaber den gesamten oder einen Teil seines Anteilsbestands zurückgibt oder umtauscht.</p> |
| Outperformance | <p>Die überdurchschnittlich positive Entwicklung des Nettoinventarwerts je Anteil über der Performance der Benchmark im Berechnungszeitraum.</p> |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)

An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

Benchmarkindizes

| Klassen | Index |
|--------------------------|---|
| USD-Klassen | ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return, USD) |
| Abgesicherte Klassen EUR | ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return - EUR Hedged) |
| Abgesicherte Klassen GBP | ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return - GBP Hedged) |
| Abgesicherte Klassen CHF | ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return - CHF Hedged) |
| Abgesicherte Klassen JPY | ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return - JPY Hedged) |

Die Benchmark ist ein weit verbreiteter Richtwert für kurzfristige Zinssätze, der einen Anhaltspunkt für die Durchschnittskurse liefert, zu denen Banken für bestimmte Zeiträume in bestimmten Währungen ungesicherte Interbankkredite aufnehmen können.

Für Klassen, die in anderen als die oben genannten Währungen denominiert sind, wird der ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return, USD) die Benchmark sein. Der Index ist gegenüber der jeweiligen Klassenwährung abgesichert.

Methode

Für jeden Berechnungszeitraum wird bzgl. jeder ausgegebenen Klasse eine erfolgsabhängige Gebühr für eine Outperformance fällig, d. h. die überdurchschnittlich positive Wertentwicklung des Nettoinventarwerts je Anteil (nach Abzug aller Kosten vor dem Abzug einer aufgelaufenen erfolgsabhängigen Gebühr, sofern dies im besten Interesse des Anteilnehmers liegt) gegenüber der Wertentwicklung der für die jeweilige Klasse geltenden Benchmark während des Berechnungszeitraums. Die erfolgsabhängige Gebühr wird an jedem Handelstag berechnet und entspricht bis zu 20 % der für diese spezielle Klasse im selben Zeitraum geltenden Outperformance.

Für den Fall, dass die Performance einer Klasse über einen Berechnungszeitraum geringer ist als die der Benchmark, fällt in Bezug auf diese Klasse keine erfolgsabhängige Gebühr an, bis eine solche kumulative Underperformance gegenüber ihrer Benchmark hereingeholt wurde.

Im Fall, dass die Klasse eine Outperformance in einem Berechnungszeitraum erzielt hat, wird eine erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf diese Klasse zahlbar. Nach der Zahlung wird die Benchmark angepasst; dieser Prozess gewährleistet, dass der Nettoinventarwert je Anteil und die Benchmark zu Beginn des Berechnungszeitraums von derselben Stelle ausgehen. Folglich entspricht der anfängliche Benchmarkwert für den nächsten Berechnungszeitraum dem Nettoinventarwert in Bezug auf die Klasse, für die die erfolgsabhängige Gebühr gezahlt wurde, d. h. wenn der Nettoinventarwert am Ende eines Berechnungszeitraums, in dem eine erfolgsabhängige Gebühr gezahlt wurde, 110 betragen würde, würde der Benchmarkwert zu Beginn des folgenden Berechnungszeitraums ebenfalls 110 betragen.

Anteilnehmer werden darauf hingewiesen, dass im Falle einer zahlbaren erfolgsabhängigen Gebühr auf die Outperformance gegenüber der Benchmark ihnen auch dann eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt wird, wenn der Nettoinventarwert je Anteil zurückgegangen ist, allerdings in einem geringeren Ausmaß als die Benchmark.

Anteilnehmer werden darauf hingewiesen, dass die erfolgsabhängige Gebühr auf Anteilklassenebene und nicht auf Ebene des individuellen Anteilnehmers berechnet wird und ihnen daher unter Umständen eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt wird, selbst wenn der Nettoinventarwert ihrer Anteile gleich geblieben oder zurückgegangen ist, zum Beispiel, wenn Anteilnehmer Anteile zu einem Zeitpunkt kaufen oder verkaufen, bei dem es sich nicht um den Beginn oder das Ende des Berechnungszeitraums handelt.

Die erfolgsabhängige Gebühr wird täglich zu jedem Bewertungszeitpunkt ermittelt und läuft zu diesem auf. Die erfolgsabhängige Gebühr wird auf den nicht für eine Verwässerungsgebühr angepassten Nettoinventarwert je Anteil berechnet, d. h. bevor eine Swing-Pricing-Anpassung erfolgte (weitere Informationen in Bezug auf „Swing Pricing“ sind im Abschnitt „Ermittlung des Nettoinventarwerts – Bewertungsanpassungen und Swing Pricing“ des Verkaufsprospekts enthalten).

Die erfolgsabhängige Gebühr wird gewöhnlich rückwirkend innerhalb von 30 Geschäftstagen nach dem 31. Dezember jeden Jahres an den Sub-Investment-Manager gezahlt. Für den Fall der Feststellung einer erfolgsabhängigen Gebühr während eines Berechnungszeitraums wird die aufgelaufene erfolgsabhängige Gebühr für solche Beträge innerhalb von 30 Geschäftstagen nach Ende des Kalenderquartals zahlbar, in dem die Feststellung erfolgte.

Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren verbleiben im Portfolio, bis sie an den Sub-Investment-Manager gezahlt werden, und partizipieren nicht an darauffolgenden Gewinnen oder Verlusten des Portfolios. Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren werden nicht zur Bedienung von Rücknahmeanträgen oder zur Zahlung von Gebühren und Aufwendungen des Portfolios oder des Fonds (außer den an den Sub-Investment-Manager zahlbaren Gebühren) herangezogen oder zu Verfügung gestellt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)

An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

Methode (Fortsetzung)

Die Verwahrstelle prüft die Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr und stellt sicher, dass sie nicht manipuliert werden kann.

Erfolgsabhängige Gebühren fallen auf realisierte und nicht realisierte Kapitalerträge (zur Klarstellung: einschließlich Anlageerträgen) unter Berücksichtigung der realisierten und nicht realisierten Verluste zum Ende des Berechnungszeitraums an. Daher können erfolgsabhängige Gebühren auf nicht realisierte Gewinne gezahlt werden, die in der Folge niemals realisiert werden.

Der Sub-Investment-Manager hat im Berichtsjahr keine erfolgsabhängigen Gebühren erhalten. Bis zum 31. Dezember 2022 hatten die vom Sub-Investment-Manager ernannten Berater („nicht verbundene Unterberater“) Anspruch auf eine erfolgsabhängige Gebühr. Die von nicht verbundenen Unterberatern vereinnahmten erfolgsabhängigen Gebühren im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 werden nachstehend aufgeführt.

| | 31. Dezember 2022 |
|--------------------------------|-------------------|
| | US\$ |
| Altiq LLP | 21.317.397 |
| BH-DG Systematic Trading LLP | 15.047.058 |
| Crabel Capital Management LLC | 4.457.671 |
| P/E Global LLC | 13.075.361 |
| Portman Square Capital | 12.616.619 |
| Sandbar Asset Management LLP | 121.822 |
| Soloda Investment Advisors LLP | 9.242.199 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)

An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)

Uncorrelated Trading*

Der Sub-Investment-Manager hat unter Umständen Anspruch auf eine erfolgsabhängige Gebühr, die aus dem Portfoliovermögen und wie genauer unten beschrieben zahlbar ist. Alle Anteilkassen im Portfolio sind PF-Klassen.

Definitionen

| | |
|-------------------------------|---|
| Benchmark | ICE BofA 1- Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index in der entsprechenden Klassenwährung. Die Benchmark ist ein weit verbreiteter Richtwert für kurzfristige Zinssätze, der einen Anhaltspunkt für die Durchschnittskurse liefert, zu denen Banken für bestimmte Zeiträume in bestimmten Währungen ungesicherte Interbankkredite aufnehmen können. |
| Berechnungszeitraum | Der Berechnungszeitraum geht normalerweise jährlich vom 1. Januar bis zum 31. Dezember, mit Ausnahme, dass: <ul style="list-style-type: none"> • im Fall der Erstausgabe von Anteilen in jeder Klasse der erste Berechnungszeitraum vom Ausgabedatum bis zum 31. Dezember des folgenden Jahres geht; • im Fall der Auflösung einer Klasse der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet; und • im Fall der Auflösung des Vertrags des Sub-Investment-Managers während eines Jahres, der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet. |
| Festlegung (Kristallisierung) | Der Punkt, an dem eine erfolgsabhängige Gebühr an den Sub-Investment-Manager zahlbar wird. Die Festlegung erfolgt entweder (i) am Ende des Berechnungszeitraums, (ii) bei Beendigung der Bestellung des Sub-Investment-Managers oder (iii) an einem Handelstag, an dem ein Anteilinhaber den gesamten oder einen Teil seines Anteilsbestands zurückgibt oder umtauscht. |
| Outperformance | Die überdurchschnittlich positive Entwicklung des Nettoinventarwerts je Anteil über der Performance der Benchmark im Berechnungszeitraum. |

Methode

Für jeden Berechnungszeitraum wird bzgl. jeder ausgegebenen Klasse eine erfolgsabhängige Gebühr für eine Outperformance fällig, d. h. die überdurchschnittlich positive Wertentwicklung des Nettoinventarwerts je Anteil (nach Abzug aller Kosten vor dem Abzug einer aufgelaufenen erfolgsabhängigen Gebühr, sofern dies im besten Interesse des Anteilinhabers liegt) gegenüber der Wertentwicklung der für die jeweilige Klasse geltenden Benchmark während des Berechnungszeitraums. Die erfolgsabhängige Gebühr wird an jedem Handelstag berechnet und entspricht bis zu 20 % der für diese spezielle Klasse im selben Zeitraum geltenden Outperformance.

Für den Fall, dass die Performance einer Klasse über einen Berechnungszeitraum geringer ist als die der Benchmark, fällt in Bezug auf diese Klasse keine erfolgsabhängige Gebühr an, bis eine solche kumulative Underperformance gegenüber ihrer Benchmark hereingeholt wurde.

Im Fall, dass die Klasse eine Outperformance in einem Berechnungszeitraum erzielt hat, wird eine erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf diese Klasse zahlbar. Nach der Zahlung wird die Benchmark angepasst, dieser Prozess gewährleistet, dass der Nettoinventarwert je Anteil und die Benchmark zu Beginn des Berechnungszeitraums von derselben Stelle ausgehen. Folglich entspricht der anfängliche Benchmarkwert für den nächsten Berechnungszeitraum dem Nettoinventarwert in Bezug auf die Klasse, für die die erfolgsabhängige Gebühr gezahlt wurde, d. h. wenn der Nettoinventarwert am Ende eines Berechnungszeitraums, in dem eine erfolgsabhängige Gebühr gezahlt wurde, 110 betragen würde, würde der Benchmarkwert zu Beginn des folgenden Berechnungszeitraums ebenfalls 110 betragen.

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass im Falle einer zahlbaren erfolgsabhängigen Gebühr auf die Outperformance gegenüber der Benchmark ihnen auch dann eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt wird, wenn der Nettoinventarwert je Anteil zurückgegangen ist, allerdings in einem geringeren Ausmaß als die Benchmark.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR**6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)****Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)**

An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)

Uncorrelated Trading* (Fortsetzung)Methode (Fortsetzung)

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass die erfolgsabhängige Gebühr auf Anteilklassenebene und nicht auf Ebene des individuellen Anteilinhabers berechnet wird und ihnen daher unter Umständen eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt wird, selbst wenn der Nettoinventarwert ihrer Anteile gleich geblieben oder zurückgegangen ist, zum Beispiel, wenn Anteilinhaber Anteile zu einem Zeitpunkt kaufen oder verkaufen, bei dem es sich nicht um den Beginn oder das Ende des Berechnungszeitraums handelt.

Die erfolgsabhängige Gebühr wird täglich zu jedem Bewertungszeitpunkt ermittelt und läuft zu diesem auf. Die erfolgsabhängige Gebühr wird auf den nicht für eine Verwässerungsgebühr angepassten Nettoinventarwert je Anteil berechnet, d. h. bevor eine Swing-Pricing-Anpassung erfolgte (weitere Informationen in Bezug auf „Swing Pricing“ sind im Abschnitt „Ermittlung des Nettoinventarwerts – Bewertungsanpassungen und Swing Pricing“ des Verkaufsprospekts enthalten).

Die erfolgsabhängige Gebühr wird gewöhnlich rückwirkend innerhalb von 30 Geschäftstagen nach dem 31. Dezember jeden Jahres an den Sub-Investment-Manager gezahlt. Für den Fall der Feststellung einer erfolgsabhängigen Gebühr während eines Berechnungszeitraums wird die aufgelaufene erfolgsabhängige Gebühr für solche Beträge innerhalb von 30 Geschäftstagen nach Ende des Kalenderquartals zahlbar, in dem die Feststellung erfolgte.

Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren verbleiben im Portfolio, bis sie an den Sub-Investment-Manager gezahlt werden, und partizipieren nicht an darauffolgenden Gewinnen oder Verlusten des Portfolios. Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren werden nicht zur Bedienung von Rücknahmeanträgen oder zur Zahlung von Gebühren und Aufwendungen des Portfolios oder des Fonds (außer den an den Sub-Investment-Manager zahlbaren Gebühren) herangezogen oder zu Verfügung gestellt.

Die Verwahrstelle prüft die Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr und stellt sicher, dass sie nicht manipuliert werden kann.

Erfolgsabhängige Gebühren fallen auf realisierte und nicht realisierte Kapitalerträge (zur Klarstellung: einschließlich Anlageerträgen) unter Berücksichtigung der realisierten und nicht realisierten Verluste zum Ende des Berechnungszeitraums an. Daher können erfolgsabhängige Gebühren auf nicht realisierte Gewinne gezahlt werden, die in der Folge niemals realisiert werden.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden vom Portfolio keine erfolgsabhängigen Gebühren an den Sub-Investment-Manager gezahlt (31. Dezember 2022: 1.351 US\$).

* Das Portfolio wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

Gebühren der Verwahrstelle

Die Gesellschaft bezahlt der Verwahrstelle eine Gebühr für Treuhanddienstleistungen für jedes Portfolio die maximal 0,02 % pro Jahr des NIW des jeweiligen Portfolios beträgt und monatlich anfällt und monatlich rückwirkend zahlbar ist. Die Verwahrstelle hat auch Anspruch auf Erstattung von dem Fonds aus dem Portfoliosvermögen von Verwahrgebühren, Transaktionsgebühren und angemessenen Auslagen („Depotbankgebühren“), die zugunsten des Portfolios entstehen, einschließlich der Gebühren (die normale kommerzielle Sätze nicht übersteigen werden) und angemessener Auslagen von Unter-Depotbanken, die von der Verwahrstelle beauftragt werden.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

7. HONORARE UND AUFWENDUNGEN DER DIREKTOREN

Die Direktoren haben als Vergütung für ihre Dienste Anspruch auf ein Honorar, dessen Höhe von Zeit zu Zeit von den Direktoren festgelegt wird, wobei der an einen Direktor jährlich in Bezug auf den Fonds zu zahlende Betrag der Vergütung 75.000 EUR (oder 85.000 EUR im Falle eines Vorsitzenden des Fonds) oder einen anderen Betrag, den die Direktoren jeweils ggf. festlegen, nicht überschreiten wird. Die Direktoren sowie diese ggf. vertretende Direktoren haben Anspruch auf die Erstattung sämtlicher angemessener Reise-, Hotel- und anderer Kosten, die ihnen bei der Teilnahme an Sitzungen der Direktoren oder der Anteilinhaber oder anderen Versammlungen im Zusammenhang mit dem Geschäftsbetrieb des Fonds entstehen. Sämtliche auf die Honorare der Direktoren gezahlten Lohnsteuern sind in den Gesamtkosten enthalten. Keiner der Direktoren hat einen Dienstvertrag mit dem Fonds abgeschlossen, derartige Verträge sind auch nicht vorgesehen, und kein Direktor ist in der Unternehmensleitung des Fonds tätig. Die Direktoren, die zugleich Mitarbeiter von Neuberger Berman Europe Limited sind, erhalten für ihre Dienstleistungen als Direktoren der Gesellschaft kein Honorar.

Die Gesamtbezüge der Direktoren (einschließlich Spesen) für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 betragen insgesamt 234.165 US\$ (31. Dezember 2022: 259.448 US\$), von denen 19.272 US\$ am Jahresende noch ausstanden (31. Dezember 2022: 60.237 US\$).

Zum 31. Dezember 2023 waren Michelle Green und Alex Duncan Direktoren und ebenfalls bei der Neuberger Berman Europe Limited („NBEL“), dem Sub-Investment-Manager und der Vertriebsstelle des Fonds, angestellt. Bis zum 15. Februar 2023 war Frau Michelle Green zudem eine Direktorin der Neuberger Berman Asset Management Ireland Limited („NBAMIL“), dem Manager des Fonds. Frau Gráinne Alexander ist zudem Direktorin von NBAMIL. Michelle Green und Alex Duncan haben sich freiwillig bereit erklärt auf ihren Anspruch auf eine Vergütung in Hinblick auf ihre Pflichten als Direktoren für das zum 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr zu verzichten (31. Dezember 2022: ebenso).

Die Honorare der Direktoren werden vor Abzug der Einkommensteuer ausgewiesen. Von den Direktoren wurden keine Sachleistungen bezogen.

8. VERGÜTUNG DER ABSCHLUSSPRÜFER

Ernst & Young, Chartered Accountants haben für ihre im Geschäftsjahr geleistete Arbeit für den Fonds folgende Vergütung (ohne MwSt.) erhalten:

| | | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
|--|-------------------------------|-------------------|-------------------|
| | | US\$ | US\$ |
| Gesetzliches Prüfungshonorar: | - Ernst & Young (Irland): | 481.925 | 482.682 |
| Sonstige Honorare ohne Prüfungshonorare: | - Ernst & Young (Österreich): | 130.939 | 141.982 |
| | - Ernst & Young (Schweiz): | 130.000 | 126.681 |

9. SONSTIGE GEBÜHREN UND KOSTEN

Die Transaktionskosten sind die beim Kauf, bei der Emission oder beim Verkauf von finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten anfallenden Kosten. Zu den Transaktionskosten gehören Gebühren und Provisionen für Makler und Händler, die an Aufsichtsbehörden und Börsen zahlbaren Gebühren und bei der Übertragung fällig werdenden Steuern und Abgaben. Die Transaktionskosten erstrecken sich nicht auf Auf- oder Abschläge auf Fremdkapitalanlagen, Finanzierungskosten oder interne Verwaltungs- bzw. Haltekosten. Diese Kosten werden verbucht, sobald sie anfallen und für die Zwecke der Finanzberichterstattung in der Gewinn- und Verlustrechnung als Aufwand erfasst.

Der Fonds und die Portfolios zahlen auch bestimmte sonstige Kosten, Gebühren, Honorare und Aufwendungen, die im Rahmen ihres Betriebs entstehen. Diese können insbesondere Gebühren und Kosten enthalten, die im Zusammenhang mit Bank- und Maklerdienstleistungen beim Kauf und Verkauf von Wertpapieren der Portfolios entstehen, Steuern, Versicherungen, die Kosten und Aufwendungen für die Buchführung und die Abfassung, den Druck, die Veröffentlichung und Verteilung der Verkaufsprospekte, Nachträge, Jahres- und Halbjahresberichte und sonstiger Dokumente und Informationen (in den jeweils notwendigen Sprachen) für bestehende oder potenzielle Anteilinhaber (einschließlich der Kosten für die Entwicklung und Verbesserung von Software und elektronischen Übertragungstechniken zur Verteilung dieser Dokumente oder Informationen), die Kosten für die Veröffentlichung von Preis- und Renditeinformationen in den relevanten Medien, die Kosten und Aufwendungen für das Einholen von Genehmigungen oder Registrierungen der Gesellschaft oder von Anteilen bei den Aufsichtsbehörden verschiedener Rechtsordnungen, einschließlich etwaiger von der Central Bank of Ireland erhobener Abgaben, die Kosten für die Notierung und Aufrechterhaltung der Notierung von Anteilen an einer Börse, Marketing- und Werbekosten, die Kosten für die Einberufung und Abhaltung der Versammlungen der Direktoren und der Anteilinhaber, die Kosten für die Ausübung der Stimmrechte im Zusammenhang mit der Anlage der Gesellschaft im besten Interesse der Anteilinhaber und die Honorare und Aufwendungen für Rechts-, Rechnungsprüfungs- und andere Beratungsleistungen, sämtliche Kosten, die durch die Auflösung oder Liquidierung der Gesellschaft entstehen, sowie alle weiteren Kosten und Aufwendungen (einmalige und außerordentliche Kosten und Aufwendungen eingeschlossen), die von Zeit zu Zeit entstehen und von den Direktoren als notwendig oder angemessen für den fortdauernden Geschäftsbetrieb der Gesellschaft oder eines Portfolios genehmigt wurden. Im Zusammenhang mit der Registrierung des Fonds oder der Anteile zum Verkauf in bestimmten Rechtsordnungen zahlt der Fonds die Gebühren und Kosten von Zahl- und Informationsstellen und/oder Korrespondenzbanken. Diese Zahlungen erfolgen zu marktüblichen Sätzen.

Der Manager begleicht alle Kosten für von ihm bezogenes Research direkt, ungeachtet der Bezugsquelle. Sub-Investment-Manager mit Sitz außerhalb der EU, die bezogenes Research nicht in die EU weiterleiten, können dem betreffenden Portfolio durch Bereitstellung eines jährlichen Research-Budgets für jedes Portfolio Research-Kosten in Rechnung stellen. Die Abgrenzungen für Research-Kosten für Uncorrelated Strategies bzw. Uncorrelated Trading im zum 31. Dezember 2023 endenden Geschäftsjahr beliefen sich auf 4.979.140 USD bzw. 50.854 USD (31. Dezember 2022: 4.954.833 USD bzw. 223.050 USD).

Für die Zwecke des Jahresabschlusses werden Gründungsaufwendungen in der Gewinn- und Verlustrechnung als Aufwand erfasst. Für die Berechnung des NIW pro Anteil Aktie für Handelszwecke der Anteilinhaber werden Gründungsaufwendungen über die ersten zwei Jahre der Laufzeit des Portfolios abgeschrieben.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN

Gemäß FRS 102 „Transaktionen mit nahe stehenden Parteien“ gelten Parteien als nahe stehend, wenn eine Partei die Möglichkeit hat, die Kontrolle über die andere Partei auszuüben oder bei finanziellen oder betrieblichen Entscheidungen entscheidenden Einfluss auf die andere Partei auszuüben.

Michelle Green und Alex Duncan sind Direktoren des Fonds und sind auch bei der NBEL, dem Sub-Investment-Manager und der Vertriebsstelle des Fonds, angestellt. Bis zum 15. Februar 2023 war Frau Michelle Green auch Direktorin von NBAMIL, der Manager der Gesellschaft. Frau Gráinne Alexander ist zudem Direktorin von NBAMIL. Die von NBEL und NBAMIL in den Jahren zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 erhältlichen Gebühren sind in der nachstehenden Tabelle aufgeführt. Nähere Angaben zu den in den zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 gezahlten Honoraren der Direktoren finden sich in Anmerkung 7.

| Managementgebühren, Gebühren der Verwaltungsstelle und erfolgsabhängige Gebühren* | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
|--|-------------------|-------------------|
| | US\$ | US\$ |
| Von NBAMIL erhaltene Managementgebühren und Gebühren der Verwaltungsstelle, ohne Verzichte | 197.829.109 | 225.475.911 |
| Beratungsgebühren | 17.684.684 | - |
| Beratungsgebühren und Kostenverzichte | (3.634.372) | (3.103.202) |
| Ausstehende Managementgebühren | 16.054.874 | 18.121.204 |
| Von NBAMIL erhaltene erfolgsabhängige Gebühren | 1.553.554 | 89.185 |
| Ausstehende erfolgsabhängige Gebühren | - | 89.185 |

*Weitere Informationen zu den Managementgebühren und erfolgsabhängigen Gebühren finden sich in Anmerkung 6.

Zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 hielten folgende Portfolios Anteile an anderen, von mit dem Manager verbundenen Unternehmen verwalteten Portfolios:

| Portfolio | Bestand* | Verwaltet von | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|--|-------------------------------------|---------------|-------------------|------------|-------------------|------------|
| | | | Anteile | Wert | Anteile | Wert |
| Corporate Hybrid Bond | Global Investment Grade Credit | NBAMIL | 1.300.000 | 10.956.412 | 1.300.000 | 10.317.170 |
| Emerging Market Debt - Hard Currency | Ultra Short Term Euro Bond | NBAMIL | 150.000 | 17.580.000 | 150.000 | 16.110.000 |
| Emerging Market Debt - Local Currency | China Bond | NBAMIL | 1.595.000 | 16.173.300 | 1.595.000 | 15.136.550 |
| Emerging Market Debt Blend | China Bond | NBAMIL | 1.409.964 | 14.297.035 | 1.409.964 | 13.380.558 |
| Global Flexible Credit Income | NB Global Monthly Income Fund Ltd** | NBAMIL | 75.108 | 66.832 | 394.721 | 338.564 |
| Global Opportunistic Bond | Global Investment Grade Credit | NBAMIL | - | - | 200.000 | 1.694.000 |
| Global Opportunistic Bond | NB Global Monthly Income Fund Ltd** | NBAMIL | 23.786 | 21.165 | 125.000 | 107.216 |
| High Yield Bond | NB Global Monthly Income Fund Ltd** | NBAMIL | 4.058.488 | 3.611.285 | 21.329.208 | 18.294.706 |
| Multi-Asset Income | China Bond | NBAMIL | - | - | 40.890 | 388.047 |
| Multi-Asset Income | Commodities | NBAMIL | - | - | 16.300 | 184.515 |
| Short Duration Emerging Market Debt | Ultra Short Term Euro Bond | NBAMIL | 425.000 | 49.810.000 | 655.000 | 70.347.000 |
| Short Duration High Yield SDG Engagement | NB Global Monthly Income Fund Ltd** | NBAMIL | 270.876 | 241.028 | 1.423.570 | 1.221.039 |
| Strategic Income | China Bond | NBAMIL | 1.208.113 | 11.936.155 | 1.208.113 | 11.815.344 |
| Strategic Income | Euro Bond Absolute Return | NBAMIL | 760.691 | 9.158.724 | 945.691 | 10.270.208 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio (Fortsetzung) | Bestand* | Verwaltet von | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|-------------------------|-------------------------------------|---------------|-------------------|------------|-------------------|------------|
| | | | Anteile | Wert | Anteile | Wert |
| Strategic Income | European High Yield Bond | NBAMIL | 486.855 | 6.382.668 | 486.855 | 5.477.118 |
| Strategic Income | Global Flexible Credit Income | NBAMIL | 459.982 | 5.570.377 | 459.982 | 4.921.803 |
| Strategic Income | Global High Yield SDG Engagement | NBAMIL | 654.438 | 8.952.716 | 654.438 | 8.062.679 |
| Strategic Income | Global Investment Grade Credit | NBAMIL | 2.000.000 | 18.620.000 | 2.000.000 | 16.940.000 |
| Strategic Income | NB Global Monthly Income Fund Ltd** | NBAMIL | 163.871 | 145.814 | 861.209 | 738.685 |

*Zum 31. Dezember 2023 (ggf. 31. Dezember 2022) betrug die effektive Managementgebühr nach Ermäßigung(en) für jede der oben genannten Bestände in jedem Portfolio 0,00 %.

** Die Managementgebühr für den NB Global Monthly Income Fund Ltd beträgt 0,75 %.

Der Manager gewährte den vorstehend genannten Portfolios im Zusammenhang mit ihren Anlagen einen Rabatt, so dass ihre effektiven Managementgebührensätze für die Anlagen 0,00 % betragen (31. Dezember 2022: gleich). Der von jedem Portfolio gewährte Gebührenverzicht wird unter „Verzicht auf Beratungsgebühren“ in den Gewinn- und Verlustrechnungen ausgewiesen.

Zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 wurden die Überkreuzinvestitionen zwischen den Portfolios der Gesellschaft vom konsolidierten Abschluss ausgeschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

Den Direktoren sind mit Ausnahme der in diesem Jahresabschluss angegebenen keine Transaktionen mit nahe stehenden Parteien im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 bekannt (31. Dezember 2022: ebenso).

Zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 hatten die folgenden Anteilhaber, die als nahe stehende Parteien galten, folgende Anlagen im Fonds getätigt.

| Portfolio | Anteilklasse | Anteilhaber | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
|----------------------|---|--------------------------------------|--------------------|--------------------|
| | | | Anzahl der Anteile | Anzahl der Anteile |
| 5G Connectivity | Thesaurierende Klasse AUD I2 | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 4.665 | - |
| 5G Connectivity | Thesaurierende Klasse CHF A | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.627 | - |
| 5G Connectivity | Thesaurierende Klasse CHF I | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.627 | - |
| 5G Connectivity | Thesaurierende Klasse CHF I2 | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.675 | - |
| 5G Connectivity | Thesaurierende Klasse CNY I2 | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.181 | - |
| 5G Connectivity | Thesaurierende Klasse EUR I | Neuberger Berman Asia Holdings LLC | - | 1.871 |
| 5G Connectivity | Thesaurierende Klasse EUR I2 | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.791 | - |
| 5G Connectivity | Thesaurierende Klasse EUR I5 | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 1.965 | 1.965 |
| 5G Connectivity | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.326 | 2.326 |
| 5G Connectivity | Thesaurierende Klasse GBP I2 | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.400 | - |
| 5G Connectivity | Thesaurierende Klasse HKD I2 | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 23.473 | - |
| 5G Connectivity | Thesaurierende Klasse SGD I2 | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.039 | - |
| 5G Connectivity | Thesaurierende Klasse USD I | Mitarbeiter von Neuberger Berman | - | 500 |
| 5G Connectivity | Ausschüttende Klasse USD I | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | - | 552 |
| 5G Connectivity | Thesaurierende Klasse USD I3 | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000 | 1.000 |
| 5G Connectivity | Thesaurierende Klasse USD I5 | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 9.953 | 9.953 |
| 5G Connectivity | Thesaurierende Klasse USD Z | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 108.423 | 112.195 |
| China A-Share Equity | Thesaurierende Klasse CNY I | Neuberger Berman Asia Holdings LLC | 688 | 688 |
| China A-Share Equity | Thesaurierende Klasse CNY I | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 774 | 774 |
| China A-Share Equity | Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Asia Holdings LLC | 1.000 | 1.000 |
| China A-Share Equity | Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Employee | 1.934 | 1.934 |
| China A-Share Equity | Ausschüttende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Asia Holdings LLC | 250.091 | 250.091 |
| China Bond | Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.993 | 1.993 |
| China Bond | Ausschüttende Klasse CNY I | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.347 | 2.347 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio | Anteilklasse | Anteilinhaber | 31. Dezember 2023 Anzahl der Anteile | 31. Dezember 2022 Anzahl der Anteile |
|---------------------------------|---|---|---|---|
| China Bond | Thesaurierende Klasse CNY Z | Neuberger Berman Employee | 1.218 | 1.218 |
| China Bond | Thesaurierende Klasse CNY Z | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 614 | 614 |
| China Bond | Thesaurierende Klasse GBP I2 | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.176 | 2.176 |
| China Bond | Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.003 | 1.003 |
| China Bond | Thesaurierende Klasse USD Z | Emerging Market Debt - Local Currency | 1.595.000 | 1.595.000 |
| China Bond | Thesaurierende Klasse USD Z | Emerging Market Debt Blend | 1.409.964 | 1.409.964 |
| China Bond | Thesaurierende Klasse USD Z | Multi-Asset Income | - | 40.890 |
| China Bond | Thesaurierende Klasse USD Z | Neuberger Berman Employee | 40.000 | 40.000 |
| China Bond | Thesaurierende Klasse USD Z (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Employee | 196 | 7.283 |
| China Bond | Thesaurierende Klasse USD Z (nicht währungsgesichert) | Strategic Income | 1.208.113 | 1.208.113 |
| China Equity | Thesaurierende Klasse EUR Z | Neuberger Berman Employee | 891 | 891 |
| China Equity | Thesaurierende Klasse USD Z | Neuberger Berman Employee | 16.177 | 16.177 |
| Climate Innovation ¹ | Thesaurierende Klasse USD A | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000 | - |
| Climate Innovation ¹ | Thesaurierende Klasse USD I | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000 | - |
| Climate Innovation ¹ | Thesaurierende Klasse USD I5 | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000 | - |
| Climate Innovation ¹ | Thesaurierende Klasse USD Z | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 300.000 | - |
| CLO Income | Thesaurierende Klasse EUR A | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.824 | 2.824 |
| CLO Income | Thesaurierende Klasse USD A | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 3.144 | 3.144 |
| CLO Income | Thesaurierende Klasse USD Z | Neuberger Berman Employee | 51.167 | 42.619 |
| Commodities ² | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 806 | 806 |
| Commodities ² | Thesaurierende Klasse GBP I5 | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | - | 2.290 |
| Commodities ² | Thesaurierende Klasse USD I | Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd | 1.431 | 1.431 |
| Commodities ² | Thesaurierende Klasse USD Z | Multi-Asset Income | - | 16.300 |
| Commodities ² | Thesaurierende Klasse USD Z | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | - | 1.000 |
| Commodities ² | Thesaurierende Klasse USD Z | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 15.263 | 9.284 |
| Corporate Hybrid Bond | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.390 | 1.390 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio | Anteilklasse | Anteilinhaber | 31. Dezember 2023 Anzahl der Anteile | 31. Dezember 2022 Anzahl der Anteile |
|---------------------------------------|--|--------------------------------------|---|---|
| Corporate Hybrid Bond | Thesaurierende Klasse EUR I | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 15.690 | 9.000 |
| Corporate Hybrid Bond | Ausschüttende Klasse EUR I2 | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | - | 2.462 |
| Corporate Hybrid Bond | Thesaurierende Klasse GBP I | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 973 | 973 |
| Corporate Hybrid Bond | Ausschüttende Klasse USD A | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 3.000 | 3.000 |
| Corporate Hybrid Bond | Ausschüttende Klasse USD I | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 3.000 | 3.000 |
| Corporate Hybrid Bond | Ausschüttende Klasse USD I2 | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.128 | 1.128 |
| Corporate Hybrid Bond | Thesaurierende Klasse USD Z | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 33.729 | 33.729 |
| Emerging Market Debt - Hard Currency | Thesaurierende Klasse CHF I2 | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.911 | 2.911 |
| Emerging Market Debt - Hard Currency | Thesaurierende Klasse CHF P | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.118 | 1.118 |
| Emerging Market Debt - Hard Currency | Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | - | 1.008 |
| Emerging Market Debt - Hard Currency | Thesaurierende Klasse EUR I4 | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.644 | - |
| Emerging Market Debt - Hard Currency | Thesaurierende Klasse EUR P | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | - | 946 |
| Emerging Market Debt - Hard Currency | Thesaurierende Klasse EUR Z | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 59.506 | 36.062 |
| Emerging Market Debt - Hard Currency | Thesaurierende Klasse GBP P | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | - | 978 |
| Emerging Market Debt - Hard Currency | Ausschüttende Klasse USD A | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000 | 1.000 |
| Emerging Market Debt - Hard Currency | Ausschüttende Klasse USD I2 | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | - | 1.000 |
| Emerging Market Debt - Hard Currency | Thesaurierende Klasse USD Z | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 9.752 | 9.752 |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Thesaurierende Klasse AUD B | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 824 | 824 |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Thesaurierende Klasse AUD C2 | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 925 | - |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Thesaurierende Klasse AUD E | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.494 | 1.494 |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Thesaurierende Klasse AUD T | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.472 | 1.472 |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Thesaurierende Klasse EUR I | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 14.328 | 14.328 |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Thesaurierende Klasse GBP I | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 25.991 | 7.903 |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Thesaurierende Klasse GBP I | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.011 | 1.011 |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Thesaurierende Klasse SEK A | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 11.535 | 11.535 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio | Anteilklasse | Anteilinhaber | 31. Dezember 2023 Anzahl der Anteile | 31. Dezember 2022 Anzahl der Anteile |
|---|---|---|---|---|
| Emerging Market Debt - Local Currency | Thesaurierende Klasse USD B | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.000 | 1.000 |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Thesaurierende Klasse USD E | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.000 | 1.000 |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) | Bond-Plus Income & Growth Multi-Asset Class Securities Investment Trust | 4.340.412 | 5.097.097 |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) | Global Strategic Income | 192.560 | 192.560 |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Thesaurierende Klasse USD I5 | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.579 | - |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Thesaurierende Klasse USD T | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 950 | 950 |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Thesaurierende Klasse ZAR C2 | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.596 | - |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Thesaurierende Klasse ZAR E | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 855 | 855 |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Thesaurierende Klasse ZAR T | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.683 | 1.683 |
| Emerging Market Debt Blend | Ausschüttende Klasse EUR I3 | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 3.000 | 3.000 |
| Emerging Market Debt Blend | Thesaurierende Klasse EUR Z | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 13.085 | 9.487 |
| Emerging Market Debt Blend | Ausschüttende Klasse GBP I | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | - | 746 |
| Emerging Market Debt Blend | Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 746 | 746 |
| Emerging Market Debt Blend | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 772 | 772 |
| Emerging Market Debt Blend | Thesaurierende Klasse NOK U | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.286 | 2.286 |
| Emerging Market Debt Blend | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 699 | 699 |
| Emerging Market Debt Blend | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.025 | 1.025 |
| Emerging Market Debt Blend | Ausschüttende Klasse USD I | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 9 | 9 |
| Emerging Market Debt Blend | Thesaurierende Klasse USD Z | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 9.460 | 9.460 |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | Thesaurierende Klasse NOK I | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 808 | 808 |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | Thesaurierende Klasse NOK I3 | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 3.219 | - |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | Thesaurierende Klasse USD Z | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 81 | 81 |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | Thesaurierende Klasse USD Z | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 155.674 | 250.358 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio | Anteilklasse | Anteilinhaber | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
|--------------------------------|--|--------------------------------------|--------------------|--------------------|
| | | | Anzahl der Anteile | Anzahl der Anteile |
| Emerging Markets Equity | Thesaurierende Klasse AUD B | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.356 | 1.356 |
| Emerging Markets Equity | Thesaurierende Klasse AUD C2 | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.575 | - |
| Emerging Markets Equity | Thesaurierende Klasse AUD E | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.356 | 1.356 |
| Emerging Markets Equity | Thesaurierende Klasse AUD T | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.662 | 2.662 |
| Emerging Markets Equity | Ausschüttende Klasse CAD I (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 8.283 | 8.283 |
| Emerging Markets Equity | Thesaurierende Klasse EUR M | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 901 | 901 |
| Emerging Markets Equity | Thesaurierende Klasse EUR Z | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 22.279 | 22.279 |
| Emerging Markets Equity | Thesaurierende Klasse GBP Z | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 800 | 800 |
| Emerging Markets Equity | Thesaurierende Klasse USD C2 | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 967 | - |
| Emerging Markets Equity | Thesaurierende Klasse USD T | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 670 | 670 |
| Emerging Markets Equity | Thesaurierende Klasse USD Z | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 22.606 | 24.884 |
| Emerging Markets Equity | Thesaurierende Klasse ZAR B | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.410 | 1.410 |
| Emerging Markets Equity | Thesaurierende Klasse ZAR E | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.410 | 1.410 |
| Emerging Markets Equity | Thesaurierende Klasse ZAR T | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.765 | 2.765 |
| Emerging Markets Select Equity | Thesaurierende Klasse USD I | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | - | 814 |
| Euro Bond | Thesaurierende Klasse EUR I | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 3.000 | 3.000 |
| Euro Bond | Ausschüttende Klasse EUR I | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 978.926 | 978.926 |
| Euro Bond Absolute Return | Thesaurierende Klasse EUR I | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 28.155 | 28.155 |
| Euro Bond Absolute Return | Ausschüttende Klasse EUR I | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 930 | 930 |
| Euro Bond Absolute Return | Thesaurierende Klasse USD Z | Neuberger Berman Asia Holdings LLC | 247.390 | 247.390 |
| Euro Bond Absolute Return | Thesaurierende Klasse USD Z | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.146.064 | 1.146.064 |
| Euro Bond Absolute Return | Thesaurierende Klasse USD Z | Strategic Income | 760.691 | 945.691 |
| European High Yield Bond | Thesaurierende Klasse EUR I | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.947 | 1.947 |
| European High Yield Bond | Thesaurierende Klasse EUR X | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 13.224 | 4.413 |
| European High Yield Bond | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | - | 1.630 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio | Anteilklasse | Anteilinhaber | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
|-----------------------------|--|---|--------------------|--------------------|
| | | | Anzahl der Anteile | Anzahl der Anteile |
| European High Yield Bond | Thesaurierende Klasse USD X | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 3.639 | 3.639 |
| European High Yield Bond | Thesaurierende Klasse USD Z | Neuberger Berman Asia Holdings LLC | - | 472.326 |
| European High Yield Bond | Thesaurierende Klasse USD Z | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 386 | 386 |
| European High Yield Bond | Thesaurierende Klasse USD Z | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | - | 827.807 |
| European High Yield Bond | Thesaurierende Klasse USD Z | Strategic Income | 486.855 | 486.855 |
| European Sustainable Equity | Ausschüttende Klasse EUR A | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.627 | 2.627 |
| European Sustainable Equity | Thesaurierende Klasse EUR I | Neuberger Berman Asia Holdings LLC | 825 | 825 |
| European Sustainable Equity | Ausschüttende Klasse EUR I | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.027 | 1.027 |
| European Sustainable Equity | Ausschüttende Klasse EUR I3 | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.593 | 2.593 |
| European Sustainable Equity | Thesaurierende Klasse EUR M | Neuberger Berman Asia Holdings LLC | 1.649 | 1.649 |
| European Sustainable Equity | Thesaurierende Klasse EUR Z | Neuberger Berman Asia Holdings LLC | 408.530 | 408.530 |
| European Sustainable Equity | Thesaurierende Klasse EUR Z | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 31.579 | 32.029 |
| European Sustainable Equity | Thesaurierende Klasse EUR Z | Neuberger Berman Group LLC | 4.772.441 | 3.124.536 |
| European Sustainable Equity | Thesaurierende Klasse USD A (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000 | 1.000 |
| European Sustainable Equity | Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000 | 1.000 |
| European Sustainable Equity | Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Group LLC | - | 1.970.793 |
| European Sustainable Equity | Thesaurierende Klasse USD M (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000 | 1.000 |
| Event Driven ² | Thesaurierende Klasse EUR I | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 922 | - |
| Event Driven ² | Ausschüttende Klasse GBP I5 | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.584 | 2.584 |
| Event Driven ² | Thesaurierende Klasse GBP P | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.584 | 2.584 |
| Event Driven ² | Thesaurierende Klasse USD I | Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd | - | 1.000.000 |
| Event Driven ² | Thesaurierende Klasse USD I | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000 | 1.000 |
| Global Bond | Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 3.937 | 3.937 |
| Global Bond | Thesaurierende Klasse EUR I Benchmark Währungsgesicherte Klasse | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.766 | - |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio | Anteilklasse | Anteilinhaber | 31. Dezember 2023 Anzahl der Anteile | 31. Dezember 2022 Anzahl der Anteile |
|----------------------------------|--|--------------------------------------|---|---|
| Global Bond | Thesaurierende Klasse USD I Benchmark Währungsgesicherte Klasse | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 3.000 | 3.000 |
| Global Bond | Thesaurierende Klasse USD I | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 888 | 888 |
| Global Bond | Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 3.000 | 3.000 |
| Global Bond | Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 4.481 | 4.481 |
| Global Equity Megatrends | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | - | 1.009 |
| Global Equity Megatrends | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 786 | - |
| Global Equity Megatrends | Thesaurierende Klasse SGD A | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.010 | - |
| Global Equity Megatrends | Thesaurierende Klasse USD C1 | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | - | 1.000 |
| Global Equity Megatrends | Thesaurierende Klasse USD I | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 12.401 | 8.678 |
| Global Equity Megatrends | Thesaurierende Klasse USD I | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | - | 1.000 |
| Global Equity Megatrends | Thesaurierende Klasse USD M | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | - | 1.000 |
| Global Equity Megatrends | Thesaurierende Klasse USD Z | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000 | 1.000 |
| Global Flexible Credit Income | Thesaurierende Klasse EUR M | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.359 | 2.359 |
| Global Flexible Credit Income | Thesaurierende Klasse USD I | Neuberger Berman Asia Holdings LLC | - | 3.000 |
| Global Flexible Credit Income | Ausschüttende Klasse USD I | Neuberger Berman Asia Holdings LLC | 7.763 | 7.763 |
| Global Flexible Credit Income | Thesaurierende Klasse USD Z | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 32.935 | 22.231 |
| Global Flexible Credit Income | Thesaurierende Klasse USD Z | Strategic Income | 459.982 | 459.982 |
| Global High Yield SDG Engagement | Ausschüttende Klasse AUD I | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 4.223 | 4.223 |
| Global High Yield SDG Engagement | Thesaurierende Klasse CHF I4 | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.931 | 2.931 |
| Global High Yield SDG Engagement | Ausschüttende Klasse CHF I4 | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.931 | 2.931 |
| Global High Yield SDG Engagement | Thesaurierende Klasse CHF X | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.931 | 2.931 |
| Global High Yield SDG Engagement | Thesaurierende Klasse EUR I4 | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.846 | 2.846 |
| Global High Yield SDG Engagement | Ausschüttende Klasse EUR I4 | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.846 | 2.846 |
| Global High Yield SDG Engagement | Thesaurierende Klasse EUR X | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.846 | 2.846 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio | Anteilklasse | Anteilinhaber | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
|--------------------------------------|----------------------------------|--------------------------------------|--------------------|--------------------|
| | | | Anzahl der Anteile | Anzahl der Anteile |
| Global High Yield SDG Engagement | Thesaurierende Klasse EUR Z (PF) | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 13.678 | - |
| Global High Yield SDG Engagement | Thesaurierende Klasse EUR Z (PF) | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.539 | 2.539 |
| Global High Yield SDG Engagement | Thesaurierende Klasse GBP I4 | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.398 | 2.398 |
| Global High Yield SDG Engagement | Thesaurierende Klasse GBP X | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.398 | 2.398 |
| Global High Yield SDG Engagement | Thesaurierende Klasse USD A | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.796 | 1.796 |
| Global High Yield SDG Engagement | Thesaurierende Klasse USD I | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 816 | 816 |
| Global High Yield SDG Engagement | Thesaurierende Klasse USD I4 | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.000 | 1.000 |
| Global High Yield SDG Engagement | Ausschüttende Klasse USD M | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.208 | 1.208 |
| Global High Yield SDG Engagement | Thesaurierende Klasse USD X | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000 | 1.000 |
| Global High Yield SDG Engagement | Thesaurierende Klasse USD X | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.013 | 1.013 |
| Global High Yield SDG Engagement | Thesaurierende Klasse USD Z | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 2.226 | 2.226 |
| Global High Yield SDG Engagement | Thesaurierende Klasse USD Z | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 789 | 789 |
| Global High Yield SDG Engagement | Thesaurierende Klasse USD Z | Strategic Income | 654.438 | 654.438 |
| Global High Yield Sustainable Action | Thesaurierende Klasse USD I | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | - | 1.000 |
| Global High Yield Sustainable Action | Ausschüttende Klasse USD I | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | - | 1.458.132 |
| Global High Yield Sustainable Action | Thesaurierende Klasse USD X | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | - | 1.000 |
| Global Investment Grade Credit | Thesaurierende Klasse EUR I | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.730 | - |
| Global Investment Grade Credit | Thesaurierende Klasse USD I | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.000 | 1.000 |
| Global Investment Grade Credit | Thesaurierende Klasse USD X | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.000 | 1.000 |
| Global Investment Grade Credit | Thesaurierende Klasse USD Z | Corporate Hybrid Bond | 1.300.000 | 1.300.000 |
| Global Investment Grade Credit | Thesaurierende Klasse USD Z | Global Opportunistic Bond | - | 200.000 |
| Global Investment Grade Credit | Thesaurierende Klasse USD Z | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 535 | - |
| Global Investment Grade Credit | Thesaurierende Klasse USD Z | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.498.000 | 1.498.000 |
| Global Investment Grade Credit | Thesaurierende Klasse USD Z | Strategic Income | 2.000.000 | 2.000.000 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio | Anteilklasse | Anteilinhaber | 31. Dezember 2023 Anzahl der Anteile | 31. Dezember 2022 Anzahl der Anteile |
|-------------------------------|--|--------------------------------------|---|---|
| Global Opportunistic Bond | Thesaurierende Klasse EUR I | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.530 | - |
| Global Opportunistic Bond | Thesaurierende Klasse GBP P | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.295 | 2.295 |
| Global Opportunistic Bond | Thesaurierende Klasse USD A | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.175 | 1.175 |
| Global Opportunistic Bond | Thesaurierende Klasse USD I | Neuberger Berman Group LLC | 669 | 669 |
| Global Opportunistic Bond | Ausschüttende Klasse USD I | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.083 | 1.083 |
| Global Real Estate Securities | Thesaurierende Klasse EUR M | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.000 | 1.000 |
| Global Real Estate Securities | Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert) | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 18.144 | 9.210 |
| Global Real Estate Securities | Thesaurierende Klasse GBP Z | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 500 | 500 |
| Global Real Estate Securities | Ausschüttende Klasse USD I5 | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 3.315 | 3.315 |
| Global Real Estate Securities | Thesaurierende Klasse USD Z | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 9.811 | 9.811 |
| Global Sustainable Equity | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Asia Holdings LLC | 1.649 | 1.649 |
| Global Sustainable Equity | Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert) | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 120.430 | 122.222 |
| Global Sustainable Equity | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | - | 722 |
| Global Sustainable Equity | Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 722 | 722 |
| Global Sustainable Equity | Thesaurierende Klasse USD A | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000 | 1.000 |
| Global Sustainable Equity | Thesaurierende Klasse USD I | Neuberger Berman Asia Holdings LLC | - | 1.000 |
| Global Sustainable Equity | Thesaurierende Klasse USD I | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 9.518 | 9.518 |
| Global Sustainable Equity | Ausschüttende Klasse USD I | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.131 | 1.131 |
| Global Sustainable Equity | Thesaurierende Klasse USD M | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | - | 1.000 |
| Global Sustainable Equity | Thesaurierende Klasse USD Z | Neuberger Berman Asia Holdings LLC | 528.063 | 528.063 |
| Global Sustainable Equity | Thesaurierende Klasse USD Z | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000 | 1.000 |
| Global Sustainable Equity | Thesaurierende Klasse USD Z | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 160 | 160 |
| Global Sustainable Equity | Thesaurierende Klasse USD Z | Neuberger Berman Group LLC | 2.481.151 | 2.481.151 |
| Global Sustainable Value | Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 927 | 927 |
| Global Sustainable Value | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 823 | - |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio | Anteilklasse | Anteilinhaber | 31. Dezember 2023 Anzahl der Anteile | 31. Dezember 2022 Anzahl der Anteile |
|--------------------------|---|---|---|---|
| Global Sustainable Value | Thesaurierende Klasse USD A | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | - | 886 |
| Global Sustainable Value | Thesaurierende Klasse USD I | Neuberger Berman Group LLC | - | 613 |
| Global Sustainable Value | Thesaurierende Klasse USD Z | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 3.166 | 3.166 |
| High Yield Bond | Ausschüttende Klasse AUD T (Wöchentlich) | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.675 | 1.675 |
| High Yield Bond | Thesaurierende Klasse EUR Z | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 15.211 | 15.211 |
| High Yield Bond | Thesaurierende Klasse GBP Z | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 2.729 | 6.162 |
| High Yield Bond | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) | Bond-Plus Income & Growth Multi-Asset Class Securities Investment Trust | 3.907.647 | 5.674.132 |
| High Yield Bond | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) | Global Strategic Income | 259.531 | 483.669 |
| High Yield Bond | Thesaurierende Klasse USD P | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.208 | 1.208 |
| High Yield Bond | Thesaurierende Klasse USD Z | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 7.741 | 28.793 |
| High Yield Bond | Thesaurierende Klasse ZAR T | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.308 | 1.308 |
| InnovAsia 5G | Thesaurierende Klasse CHF I4 | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.747 | 2.747 |
| InnovAsia 5G | Thesaurierende Klasse EUR A | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.539 | 2.539 |
| InnovAsia 5G | Thesaurierende Klasse EUR I4 | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.539 | 2.539 |
| InnovAsia 5G | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.584 | 2.584 |
| InnovAsia 5G | Thesaurierende Klasse EUR X | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.539 | 2.539 |
| InnovAsia 5G | Thesaurierende Klasse SGD A | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.031 | 2.031 |
| InnovAsia 5G | Thesaurierende Klasse SGD I4 | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.031 | 2.031 |
| InnovAsia 5G | Thesaurierende Klasse SGD X | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.031 | 2.031 |
| InnovAsia 5G | Thesaurierende Klasse USD A | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.000 | 1.000 |
| InnovAsia 5G | Thesaurierende Klasse USD I | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 476.000 | 476.000 |
| InnovAsia 5G | Thesaurierende Klasse USD I4 | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 2.037 | 2.037 |
| InnovAsia 5G | Thesaurierende Klasse USD I4 | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.000 | 1.000 |
| InnovAsia 5G | Thesaurierende Klasse USD M | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000 | 1.000 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio | Anteilklasse | Anteilinhaber | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
|--------------------------|--|---|--------------------|--------------------|
| | | | Anzahl der Anteile | Anzahl der Anteile |
| InnovAsia 5G | Thesaurierende Klasse USD X | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.000 | 1.000 |
| Japan Equity Engagement | Ausschüttende Klasse EUR I5 | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.662 | - |
| Japan Equity Engagement | Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 787 | - |
| Japan Equity Engagement | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.242 | 2.242 |
| Japan Equity Engagement | Thesaurierende Klasse JPY I | Neuberger Berman Asia Holdings LLC | - | 3.000 |
| Japan Equity Engagement | Thesaurierende Klasse JPY I | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 3.576 | 3.576 |
| Japan Equity Engagement | Ausschüttende Klasse JPY I | Neuberger Berman Asia Holdings LLC | - | 497.000 |
| Japan Equity Engagement | Thesaurierende Klasse JPY I5 | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | - | 318 |
| Japan Equity Engagement | Thesaurierende Klasse JPY Z | Neuberger Berman Asia Holdings LLC | 778.814 | - |
| Japan Equity Engagement | Thesaurierende Klasse JPY Z | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 147.815 | 140.482 |
| Japan Equity Engagement | Thesaurierende Klasse JPY Z | Neuberger Berman Group LLC | 2.005.146 | 4.692.912 |
| Macro Opportunities FX | Thesaurierende Klasse EUR I | Neuberger Berman Asia Holdings LLC | 1.000 | 1.000 |
| Macro Opportunities FX | Thesaurierende Klasse EUR I | Mitarbeiter von Neuberger Berman | - | 23.771 |
| Macro Opportunities FX | Thesaurierende Klasse GBP Z | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 2.005 | 16.762 |
| Macro Opportunities FX | Thesaurierende Klasse SEK I | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.830 | 2.830 |
| Macro Opportunities FX | Thesaurierende Klasse USD I | Neuberger Berman Asia Holdings LLC | 1.081 | 1.081 |
| Macro Opportunities FX | Thesaurierende Klasse USD Z | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 7.959 | 7.959 |
| Multi-Asset Income | Ausschüttende Klasse GBP P | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | - | 2.332 |
| Multi-Asset Income | Thesaurierende Klasse USD I | Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd | - | 847 |
| Multi-Asset Income | Ausschüttende Klasse USD I | Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd | - | 2.917 |
| Next Generation Mobility | Thesaurierende Klasse EUR A | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.000 | 1.000 |
| Next Generation Mobility | Thesaurierende Klasse EUR I | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.459 | 2.459 |
| Next Generation Mobility | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | - | 2.632 |
| Next Generation Mobility | Thesaurierende Klasse USD C1 | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 10 | 1.000 |
| Next Generation Mobility | Thesaurierende Klasse USD I | Neuberger Berman Asia Holdings LLC | - | 3.000 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio | Anteilklasse | Anteilinhaber | 31. Dezember 2023 Anzahl der Anteile | 31. Dezember 2022 Anzahl der Anteile |
|--|--|--------------------------------------|---|---|
| Next Generation Mobility | Thesaurierende Klasse USD I | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 738 | 738 |
| Next Generation Mobility | Ausschüttende Klasse USD I | Neuberger Berman Asia Holdings LLC | 730 | 730 |
| Next Generation Mobility | Thesaurierende Klasse USD X | Neuberger Berman Asia Holdings LLC | 3.000 | 3.000 |
| Next Generation Mobility | Thesaurierende Klasse USD X | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 588 | 588 |
| Next Generation Space Economy ² | Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 94.928 | 94.928 |
| Next Generation Space Economy ² | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 94.928 | 94.928 |
| Next Generation Space Economy ² | Thesaurierende Klasse USD I | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 300.000 | 300.000 |
| Responsible Asian Debt - Hard Currency | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.046 | 1.046 |
| Responsible Asian Debt - Hard Currency | Thesaurierende Klasse USD A | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | - | 1.000 |
| Responsible Asian Debt - Hard Currency | Thesaurierende Klasse USD I | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | - | 1.000 |
| Responsible Asian Debt - Hard Currency | Ausschüttende Klasse USD I | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | - | 1.162.791 |
| Responsible Asian Debt - Hard Currency | Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000 | 1.000 |
| Responsible Asian Debt - Hard Currency | Thesaurierende Klasse USD I4 | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000 | 1.000 |
| Responsible Asian Debt - Hard Currency | Ausschüttende Klasse USD X (Monatlich) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000 | 1.000 |
| Responsible Asian Debt - Hard Currency | Thesaurierende Klasse USD X | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.193 | 2.193 |
| Responsible Asian Debt - Hard Currency | Thesaurierende Klasse USD Z | Neuberger Berman Asia Holdings LLC | 3.887.269 | - |
| Responsible Asian Debt - Hard Currency | Thesaurierende Klasse USD Z | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.004.281 | - |
| Responsible Asian Debt - Hard Currency | Thesaurierende Klasse USD Z | Neuberger Berman Group LLC | 848.201 | 848.201 |
| Short Duration Emerging Market Debt | Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich) | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.365 | 1.365 |
| Short Duration Emerging Market Debt | Ausschüttende Klasse GBP I | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | - | 814 |
| Short Duration Emerging Market Debt | Thesaurierende Klasse GBP P | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | - | 2.487 |
| Short Duration Emerging Market Debt | Thesaurierende Klasse SEK A | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.374 | 2.374 |
| Short Duration Emerging Market Debt | Thesaurierende Klasse USD Z | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 31.591 | 28.808 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio | Anteilklasse | Anteilinhaber | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
|--|--|---|--------------------|--------------------|
| | | | Anzahl der Anteile | Anzahl der Anteile |
| Short Duration High Yield SDG Engagement | Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 23.546 | 23.546 |
| Short Duration High Yield SDG Engagement | Thesaurierende Klasse USD I4 | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000 | - |
| Short Duration High Yield SDG Engagement | Thesaurierende Klasse USD Z | Neuberger Berman Asia Holdings LLC | 7.984 | - |
| Short Duration High Yield SDG Engagement | Thesaurierende Klasse USD Z | Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd | 2.654 | - |
| Short Duration High Yield SDG Engagement | Thesaurierende Klasse USD Z | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 876 | 839 |
| Short Duration High Yield SDG Engagement | Thesaurierende Klasse USD Z | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 40.341 | 32.263 |
| Short Duration High Yield SDG Engagement | Thesaurierende Klasse USD Z | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 3.422 | 6.782 |
| Short Duration High Yield SDG Engagement | Thesaurierende Klasse USD Z | Neuberger Berman Group LLC | 5.823 | - |
| Strategic Income | Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.137 | - |
| Strategic Income | Thesaurierende Klasse EUR A | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.861 | 2.861 |
| Strategic Income | Thesaurierende Klasse EUR I | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 83.400 | 7.239 |
| Strategic Income | Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich) | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | - | 834 |
| Strategic Income | Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 11.473 | 11.473 |
| Strategic Income | Ausschüttende Klasse JPY I | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 5.300 | - |
| Strategic Income | Thesaurierende Klasse SGD A | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 682 | 682 |
| Strategic Income | Ausschüttende Klasse USD A | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | - | 1.093 |
| Strategic Income | Thesaurierende Klasse USD Z | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 20.836 | 24.029 |
| Sustainable Asia High Yield | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | Neuberger Berman Group LLC | 1.000 | 1.000 |
| Sustainable Asia High Yield | Thesaurierende Klasse USD A | Neuberger Berman Group LLC | 1.000 | 1.000 |
| Sustainable Asia High Yield | Thesaurierende Klasse USD I | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.225 | 1.225 |
| Sustainable Asia High Yield | Thesaurierende Klasse USD Z | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 11.395 | 13.395 |
| Sustainable Asia High Yield | Thesaurierende Klasse USD Z | Neuberger Berman Group LLC | 2.395.262 | 2.395.262 |
| Sustainable Emerging Market Corporate Debt | Thesaurierende Klasse GBP I | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 787 | 787 |
| Sustainable Emerging Market Corporate Debt | Thesaurierende Klasse SEK A | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.409 | 2.409 |
| Sustainable Emerging Market Corporate Debt | Thesaurierende Klasse USD M | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | - | 1.040 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio | Anteilklasse | Anteilinhaber | 31. Dezember 2023 Anzahl der Anteile | 31. Dezember 2022 Anzahl der Anteile |
|---|------------------------------|--------------------------------------|---|---|
| Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency ² | Thesaurierende Klasse USD I | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000 | 1.000 |
| Tactical Macro ¹ | Thesaurierende Klasse USD I | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000 | - |
| Tactical Macro ¹ | Thesaurierende Klasse USD I5 | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000 | - |
| Tactical Macro ¹ | Thesaurierende Klasse USD Z | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 500.000 | - |
| Ultra Short Term Euro Bond | Thesaurierende Klasse CHF U | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 294 | 294 |
| Ultra Short Term Euro Bond | Thesaurierende Klasse EUR A | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | - | 247 |
| Ultra Short Term Euro Bond | Thesaurierende Klasse EUR I | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | - | 122 |
| Ultra Short Term Euro Bond | Ausschüttende Klasse EUR I | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 119 | 119 |
| Ultra Short Term Euro Bond | Thesaurierende Klasse EUR M | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 252 | 252 |
| Ultra Short Term Euro Bond | Thesaurierende Klasse EUR U | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 79 | 79 |
| Ultra Short Term Euro Bond | Thesaurierende Klasse EUR Z | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 19.030 | 22.356 |
| Ultra Short Term Euro Bond | Thesaurierende Klasse USD Z | Emerging Market Debt - Hard Currency | 150.000 | 150.000 |
| Ultra Short Term Euro Bond | Thesaurierende Klasse USD Z | Short Duration Emerging Market Debt | 425.000 | 655.000 |
| Uncorrelated Strategies | Thesaurierende Klasse EUR P | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.931 | 2.931 |
| Uncorrelated Strategies | Ausschüttende Klasse GBP I2 | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 858 | 858 |
| Uncorrelated Strategies | Thesaurierende Klasse GBP Z | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 21.992 | 21.992 |
| Uncorrelated Strategies | Thesaurierende Klasse USD Z | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 24.926 | 16.007 |
| US Equity | Thesaurierende Klasse USD I | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 415 | 415 |
| US Equity | Thesaurierende Klasse USD I | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | - | 997 |
| US Equity | Ausschüttende Klasse USD I | Neuberger Berman Group LLC | 229.104 | 229.104 |
| US Equity | Thesaurierende Klasse USD M | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000 | 1.000 |
| US Equity Index PutWrite | Thesaurierende Klasse EUR I | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.132 | 2.132 |
| US Equity Index PutWrite | Ausschüttende Klasse EUR I3 | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.655 | 2.655 |
| US Equity Index PutWrite | Thesaurierende Klasse EUR I4 | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.111 | 1.111 |
| US Equity Index PutWrite | Ausschüttende Klasse EUR I4 | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 2.748 | - |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio | Anteilklasse | Anteilinhaber | 31. Dezember 2023 Anzahl der Anteile | 31. Dezember 2022 Anzahl der Anteile |
|--------------------------|---|--------------------------------------|---|---|
| US Equity Index PutWrite | Thesaurierende Klasse EUR M | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.143 | 1.143 |
| US Equity Index PutWrite | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | - | 941 |
| US Equity Index PutWrite | Thesaurierende Klasse GBP I3 | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | - | 2.120 |
| US Equity Index PutWrite | Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 785 | - |
| US Equity Index PutWrite | Ausschüttende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | - | 2.187 |
| US Equity Index PutWrite | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 809 | 809 |
| US Equity Index PutWrite | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 890 | - |
| US Equity Index PutWrite | Thesaurierende Klasse USD I | Neuberger Berman Group LLC | - | 759 |
| US Equity Index PutWrite | Ausschüttende Klasse USD I3 | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000 | 1.000 |
| US Equity Index PutWrite | Thesaurierende Klasse USD M | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | - | 1.134 |
| US Equity Index PutWrite | Thesaurierende Klasse USD Z | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 102.917 | 117.446 |
| US Large Cap Value | Thesaurierende Klasse EUR A | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 3.066 | 3.066 |
| US Large Cap Value | Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Group LLC | 947 | 947 |
| US Large Cap Value | Thesaurierende Klasse EUR I | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | - | 2.688 |
| US Large Cap Value | Thesaurierende Klasse GBP I | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.528 | 2.528 |
| US Large Cap Value | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 843 | 843 |
| US Large Cap Value | Ausschüttende Klasse GBP I | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.528 | 2.528 |
| US Large Cap Value | Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 843 | 843 |
| US Large Cap Value | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Group LLC | 797 | 797 |
| US Large Cap Value | Ausschüttende Klasse GBP P | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.678 | 2.678 |
| US Large Cap Value | Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Group LLC | - | 797 |
| US Large Cap Value | Ausschüttende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 858 | 858 |
| US Large Cap Value | Thesaurierende Klasse USD I | Mitarbeiter von Neuberger Berman | - | 8.044 |
| US Large Cap Value | Thesaurierende Klasse USD I | Neuberger Berman Group LLC | - | 4.524 |
| US Large Cap Value | Thesaurierende Klasse USD Y | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000 | - |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio | Anteilklasse | Anteilinhaber | 31. Dezember 2023 Anzahl der Anteile | 31. Dezember 2022 Anzahl der Anteile |
|----------------------------|---|--------------------------------------|---|---|
| US Large Cap Value | Thesaurierende Klasse USD Z | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 20.291 | 1.016 |
| US Long Short Equity | Thesaurierende Klasse EUR I3 | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | - | 2.771 |
| US Long Short Equity | Ausschüttende Klasse GBP I3 | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.302 | 2.302 |
| US Long Short Equity | Thesaurierende Klasse USD I3 | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000 | 1.000 |
| US Long Short Equity | Thesaurierende Klasse USD M | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.115 | 1.115 |
| US Long Short Equity | Thesaurierende Klasse USD Z | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 13.313 | 13.363 |
| US Multi Cap Opportunities | Thesaurierende Klasse AUD T | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 516 | 516 |
| US Multi Cap Opportunities | Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.065 | 1.065 |
| US Multi Cap Opportunities | Thesaurierende Klasse USD I2 | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000 | - |
| US Multi Cap Opportunities | Thesaurierende Klasse USD Z | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 12.011 | 12.942 |
| US Multi Cap Opportunities | Ausschüttende Klasse USD1 I | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 268 | 268 |
| US Real Estate Securities | Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.418 | 1.418 |
| US Real Estate Securities | Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.586 | 1.586 |
| US Real Estate Securities | Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.424 | 1.424 |
| US Real Estate Securities | Thesaurierende Klasse AUD T | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.140 | 1.140 |
| US Real Estate Securities | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 943 | 943 |
| US Real Estate Securities | Ausschüttende Klasse USD I | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | - | 1.008 |
| US Real Estate Securities | Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 985 | 985 |
| US Real Estate Securities | Thesaurierende Klasse USD Z | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 15.120 | 15.008 |
| US Real Estate Securities | Thesaurierende Klasse ZAR C2 | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.776 | 2.921 |
| US Real Estate Securities | Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.790 | 1.790 |
| US Real Estate Securities | Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.208 | 1.208 |
| US Small Cap | Thesaurierende Klasse AUD B | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 727 | 727 |
| US Small Cap | Thesaurierende Klasse AUD C2 | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.010 | 1.010 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio | Anteilklasse | Anteilinhaber | 31. Dezember 2023 Anzahl der Anteile | 31. Dezember 2022 Anzahl der Anteile |
|------------------------------|---|--------------------------------------|---|---|
| US Small Cap | Thesaurierende Klasse AUD E | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 756 | 756 |
| US Small Cap | Thesaurierende Klasse AUD T | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.329 | 1.329 |
| US Small Cap | Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.531 | 2.531 |
| US Small Cap | Thesaurierende Klasse EUR Z | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 19.268 | 18.894 |
| US Small Cap | Thesaurierende Klasse USD C2 | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 153 | - |
| US Small Cap | Thesaurierende Klasse USD Z | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 8.635 | 10.663 |
| US Small Cap | Thesaurierende Klasse ZAR E | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 745 | 745 |
| US Small Cap | Thesaurierende Klasse ZAR T | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | 1.812 | 1.812 |
| US Small Cap Intrinsic Value | Thesaurierende Klasse USD A | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | - | 1.000 |
| US Small Cap Intrinsic Value | Thesaurierende Klasse USD I | Mitarbeiter von Neuberger Berman | 958 | 958 |

¹ Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

² Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN

Beizulegender Zeitwert von Anlagen

| | 5G Connectivity | | Absolute Return Multi Strategy* | |
|---|--------------------|----------------------|---------------------------------|-------------------|
| | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen | | | | |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen | (90.236.077) | (480.089.945) | (18.814) | (3.129) |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust) | (15.038.937) | (53.103.108) | (145) | (4.362) |
| | (105.275.014) | (533.193.053) | (18.959) | (7.491) |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen | 437.989.861 | (412.983.630) | (452) | (13.114) |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes) | 9.973.331 | 4.336.986 | 19 | 20 |
| | 447.963.192 | (408.646.644) | (433) | (13.094) |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten | 342.688.178 | (941.839.697) | (19.392) | (20.585) |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

* Der Absolute Return Multi Strategy wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst. Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) entstanden ausschließlich aus eingestellter Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

| | China A-Share Equity | | China Bond | |
|---|----------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
| | CNY | CNY | CNY | CNY |
| Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen | | | | |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen | (4.404.478) | (2.051.051) | 3.576.296 | (47.859.261) |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust) | 108.671 | 131.494 | 465.916 | 6.533.634 |
| | (4.295.807) | (1.919.557) | 4.042.212 | (41.325.627) |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen | 2.301.488 | (3.907.067) | 16.943.620 | 19.316.084 |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes) | (83.806) | 115.492 | 3.901.574 | (878.279) |
| | 2.217.682 | (3.791.575) | 20.845.194 | 18.437.805 |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten | (2.078.125) | (5.711.132) | 24.887.406 | (22.887.822) |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

| | China Equity | | Climate Innovation ¹ |
|--|-------------------|-------------------|---------------------------------|
| | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2023 |
| | US\$ | US\$ | US\$ |
| Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen | | | |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen | (60.500.162) | (30.904.361) | (170.258) |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust) | (8.498.656) | (5.247.061) | (3.990) |
| | (68.998.818) | (36.151.422) | (174.248) |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen | 1.062.218 | (70.415.570) | 75.353 |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes) | 2.551.593 | (12.256.852) | 15.562 |
| | 3.613.811 | (82.672.422) | 90.915 |
| Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | (65.385.007) | (118.823.844) | (83.333) |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

| | CLO Income | | Commodities ² | |
|--|-------------------|-------------------|--------------------------|-------------------|
| | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen | | | | |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen | (602.334) | (9.982.934) | (10.452.143) | (3.361.701) |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust) | (110.614) | 91.107 | (13.702) | 536 |
| | (712.948) | (9.891.827) | (10.465.845) | (3.361.165) |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen | 14.494.255 | (16.598.419) | 1.021.047 | 1.346.623 |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes) | 1.515.407 | (559.978) | (151) | 1 |
| | 16.009.662 | (17.158.397) | 1.020.896 | 1.346.624 |
| Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 15.296.714 | (27.050.224) | (9.444.949) | (2.014.541) |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

| | Corporate Hybrid Bond | | Developed Market FMP – 2027 ¹ | Emerging Market Debt - Hard Currency | |
|--|-----------------------|-------------------|--|--------------------------------------|-------------------|
| | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
| | EUR | EUR | US\$ | US\$ | US\$ |
| Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen | | | | | |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen | (152.927.709) | (102.874.764) | (21.479) | (158.287.937) | (264.197.117) |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust) | 4.348.385 | 33.878.891 | (542) | (3.381.435) | (13.182.862) |
| | (148.579.324) | (68.995.873) | (22.021) | (161.669.372) | (277.379.979) |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen | 229.282.682 | (266.900.364) | 3.780.658 | 348.695.906 | (608.219.340) |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes) | (4.304.724) | (26.066.929) | (35) | 24.401.986 | (21.966.897) |
| | 224.977.958 | (292.967.293) | 3.780.623 | 373.097.892 | (630.186.237) |
| Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 76.398.634 | (361.963.166) | 3.758.602 | 211.428.520 | (907.566.216) |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

| | Emerging Market Debt - Local Currency | | Emerging Market Debt Blend | |
|--|---------------------------------------|-------------------|----------------------------|-------------------|
| | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen | | | | |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen | (44.584.131) | (242.882.245) | (21.580.799) | (124.176.650) |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust) | (48.092.632) | (72.390.918) | (4.256.866) | (19.792.555) |
| | (92.676.763) | (315.273.163) | (25.837.665) | (143.969.205) |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen | 110.241.381 | (31.142.315) | 50.206.109 | (47.239.064) |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes) | 80.456.531 | (15.633.154) | 12.011.863 | (3.085.882) |
| | 190.697.912 | (46.775.469) | 62.217.972 | (50.324.946) |
| Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 98.021.149 | (362.048.632) | 36.380.307 | (194.294.151) |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

| | Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | | Emerging Markets Equity | |
|--|---|-------------------|-------------------------|-------------------|
| | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen | | | | |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen | (5.791.115) | (3.582.513) | (20.729.912) | (35.683.852) |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust) | (198.927) | (727.107) | (9.655.337) | (12.336.247) |
| | (5.990.042) | (4.309.620) | (30.385.249) | (48.020.099) |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen | 5.676.743 | (5.437.577) | 31.028.370 | (50.571.556) |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes) | 1.563.693 | (542.245) | 9.356.867 | (5.958.508) |
| | 7.240.436 | (5.979.822) | 40.385.237 | (56.530.064) |
| Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 1.250.394 | (10.289.442) | 9.999.988 | (104.550.163) |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

| | Emerging Markets Select Equity* | | Euro Bond | |
|--|---------------------------------|---------------------|-------------------|--------------------|
| | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | EUR | EUR |
| Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen | | | | |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen | 814.528 | (8.758.509) | (341.755) | (694.978) |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust) | (4.139.010) | (1.851.322) | (38) | 34 |
| | (3.324.482) | (10.609.831) | (341.793) | (694.944) |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen | 2.969.544 | (18.041.369) | 1.045.890 | (1.278.924) |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes) | 3.013.801 | (2.488.298) | (191) | 514 |
| | 5.983.345 | (20.529.667) | 1.045.699 | (1.278.410) |
| Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2.658.863 | (31.139.498) | 703.906 | (1.973.354) |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

* Der Emerging Markets Select Equity wurde am 7. September 2023 aufgelöst. Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) entstanden ausschließlich aus eingestellter Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

| | Euro Bond Absolute Return | | European High Yield Bond | |
|--|---------------------------|-------------------|--------------------------|-------------------|
| | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
| | EUR | EUR | EUR | EUR |
| Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen | | | | |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen | (537.540) | 1.175.597 | (2.829.393) | 3.427.555 |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust) | 32.645 | 80.644 | (37.181) | 65.204 |
| | (504.895) | 1.256.241 | (2.866.574) | 3.492.759 |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen | 2.177.741 | (3.934.536) | 19.988.179 | (5.455.410) |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes) | 33.333 | (10.940) | 136.601 | (363.029) |
| | 2.211.074 | (3.945.476) | 20.124.780 | (5.818.439) |
| Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 1.706.179 | (2.689.235) | 17.258.206 | (2.325.680) |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

| | European Sustainable Equity | | Event Driven ² | |
|--|-----------------------------|-------------------|---------------------------|-------------------|
| | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
| | EUR | EUR | US\$ | US\$ |
| Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen | | | | |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen | (13.057.162) | (11.018.173) | 4.556.622 | 415.203 |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust) | (216.771) | 478.642 | (1.737) | (7.193) |
| | (13.273.933) | (10.539.531) | 4.554.885 | 408.010 |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen | 41.047.636 | (22.422.863) | 5.050.324 | 1.100.016 |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes) | 2.003.562 | (1.713.109) | 22 | (16) |
| | 43.051.198 | (24.135.972) | 5.050.346 | 1.100.000 |
| Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 29.777.265 | (34.675.503) | 9.605.231 | 1.508.010 |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

| | Global Bond | | Global Diversified Income FMP – 2024 | |
|--|-------------------|-------------------|--------------------------------------|-------------------|
| | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen | | | | |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen | (8.533.831) | (11.391.342) | (673.325) | (10.699.366) |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust) | (1.255.928) | (5.336.500) | (734) | (895) |
| | (9.789.759) | (16.727.842) | (674.059) | (10.700.261) |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen | 10.407.766 | (11.585.556) | 4.129.633 | (7.559.634) |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes) | 2.216.541 | (1.484.440) | (1) | – |
| | 12.624.307 | (13.069.996) | 4.129.632 | (7.559.634) |
| Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2.834.548 | (29.797.838) | 3.455.573 | (18.259.895) |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

| | Global Equity Megatrends | | Global Flexible Credit Income | |
|--|--------------------------|-------------------|-------------------------------|-------------------|
| | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen | | | | |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen | 4.899.408 | 525.013 | (1.617.442) | (105.497.228) |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust) | (32.081) | (11.161) | (1.344.080) | (7.159.541) |
| | 4.867.327 | 513.852 | (2.961.522) | (112.656.769) |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen | 14.946.198 | (11.547.989) | 33.775.896 | (40.182.418) |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes) | 472.026 | (722.336) | 4.829.687 | (1.097.382) |
| | 15.418.224 | (12.270.325) | 38.605.583 | (41.279.800) |
| Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 20.285.551 | (11.756.473) | 35.644.061 | (153.936.569) |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

| | Global High Yield SDG Engagement | | Global High Yield Sustainable Action* | |
|--|----------------------------------|-------------------|---------------------------------------|-------------------|
| | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen | | | | |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen | (6.863.220) | (19.998.727) | (2.101.169) | (96.461) |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust) | 1.189.384 | (2.367.879) | (135.475) | (152.483) |
| | (5.673.836) | (22.366.606) | (2.236.644) | (248.944) |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen | 29.380.435 | (6.198.721) | 2.276.456 | (2.277.299) |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes) | 2.518.689 | 301.894 | 261.475 | (159.626) |
| | 31.899.124 | (5.896.827) | 2.537.931 | (2.436.925) |
| Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 26.225.288 | (28.263.433) | 301.287 | (2.685.869) |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

* Der Global High Yield Sustainable Action wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst. Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) entstanden ausschließlich aus eingestellter Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

| | Global Investment Grade Credit | | Global Opportunistic Bond | |
|--|--------------------------------|---------------------|---------------------------|---------------------|
| | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen | | | | |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen | (8.106.722) | (602.080) | (8.077.899) | 1.397.209 |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust) | (493.689) | (2.251.738) | (717.866) | (2.680.598) |
| | (8.600.411) | (2.853.818) | (8.795.765) | (1.283.389) |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen | 11.728.916 | (13.729.300) | 8.023.365 | (11.185.547) |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes) | 1.480.461 | (177.244) | 2.587.374 | (1.515.056) |
| | 13.209.377 | (13.906.544) | 10.610.739 | (12.700.603) |
| Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 4.608.966 | (16.760.362) | 1.814.974 | (13.983.992) |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

| | Global Real Estate Securities | | Global Sustainable Equity | |
|--|-------------------------------|-------------------|---------------------------|-------------------|
| | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen | | | | |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen | (5.663.439) | (4.205.633) | (6.450.382) | (33.189.400) |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust) | (796.662) | (1.518.559) | (697.687) | (5.755.843) |
| | (6.460.101) | (5.724.192) | (7.148.069) | (38.945.243) |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen | 6.035.750 | (10.322.033) | 35.469.091 | (27.981.018) |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes) | 729.660 | (317.326) | 2.465.642 | (1.086.634) |
| | 6.765.410 | (10.639.359) | 37.934.733 | (29.067.652) |
| Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 305.309 | (16.363.551) | 30.786.664 | (68.012.895) |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

| | Global Sustainable Value | | High Yield Bond | |
|--|--------------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen | | | | |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen | 768.987 | (1.880.826) | (162.753.558) | (222.037.281) |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust) | (281.087) | (1.207.717) | (4.742.596) | (2.727.987) |
| | 487.900 | (3.088.543) | (167.496.154) | (224.765.268) |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen | 5.771.035 | (2.242.740) | 269.412.476 | (274.505.380) |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes) | 604.492 | (68.617) | 6.186.033 | (1.339.152) |
| | 6.375.527 | (2.311.357) | 275.598.509 | (275.844.532) |
| Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 6.863.427 | (5.399.900) | 108.102.355 | (500.609.800) |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

| | InnovAsia 5G | | Japan Equity Engagement | |
|--|-------------------|---------------------|-------------------------|------------------------|
| | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | JPY | JPY |
| Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen | | | | |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen | 2.460.434 | (6.633.872) | 1.662.662.886 | (654.071.596) |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust) | (473.540) | (2.189.049) | 2.045.222 | (259.996) |
| | 1.986.894 | (8.822.921) | 1.664.708.108 | (654.331.592) |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen | 3.222.419 | (3.201.743) | 3.022.617.990 | (1.085.772.594) |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes) | 109.786 | 56.079 | 909.739 | (974.538) |
| | 3.332.205 | (3.145.664) | 3.023.527.729 | (1.086.747.132) |
| Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 5.319.099 | (11.968.585) | 4.688.235.837 | (1.741.078.724) |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

| | Macro Opportunities FX | | Multi-Asset Income* | |
|--|------------------------|--------------------|---------------------|--------------------|
| | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
| | EUR | EUR | US\$ | US\$ |
| Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen | | | | |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen | (1.665.613) | (2.168.497) | (1.243.160) | (150.944) |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust) | (6.824) | 11.958 | (17.230) | (506.021) |
| | (1.672.437) | (2.156.539) | (1.260.390) | (656.965) |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen | 938.724 | 184.774 | 1.261.196 | (2.421.627) |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes) | (629) | (22) | 121.256 | (33.291) |
| | 938.095 | 184.752 | 1.382.452 | (2.454.918) |
| Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | (734.342) | (1.971.787) | 122.062 | (3.111.883) |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

* Der Multi-Asset Income wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst. Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) entstanden ausschließlich aus eingestellter Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

| | Next Generation Mobility | | Next Generation Space Economy ² | |
|--|--------------------------|-------------------|--|-------------------|
| | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen | | | | |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen | 3.899.437 | (549.130) | 444.429 | (131.045) |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust) | (214.899) | (499.058) | (7.147) | (16.020) |
| | 3.684.538 | (1.048.188) | 437.282 | (147.065) |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen | 37.448.812 | (55.382.736) | 2.752.444 | (361.079) |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes) | 293.795 | (1.386.423) | 96.177 | 75.769 |
| | 37.742.607 | (56.769.159) | 2.848.621 | (285.310) |
| Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 41.427.145 | (57.817.347) | 3.285.903 | (432.375) |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

| | Responsible Asian Debt - Hard Currency | | Short Duration Emerging Market Debt | |
|--|--|-------------------|-------------------------------------|-------------------|
| | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen | | | | |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen | (1.467.912) | (550.962) | (159.534.063) | (702.327.934) |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust) | (48.888) | (14) | 444.634 | (6.224.469) |
| | (1.516.800) | (550.976) | (159.089.429) | (708.552.403) |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen | 2.387.666 | (1.370.732) | 311.280.105 | (384.394.924) |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes) | 48.869 | 30.608 | 13.548.869 | (8.121.043) |
| | 2.436.535 | (1.340.124) | 324.828.974 | (392.515.967) |
| Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 919.735 | (1.891.100) | 165.739.545 | (1.101.068.370) |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

| | Short Duration High Yield SDG Engagement | | Strategic Income | |
|--|--|---------------------|-------------------|----------------------|
| | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen | | | | |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen | (27.392.333) | (79.906.575) | (57.265.475) | (80.836.421) |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust) | (510.093) | (374.053) | (2.600.408) | (5.386.191) |
| | (27.902.426) | (80.280.628) | (59.865.883) | (86.222.612) |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen | 38.039.009 | (9.473.114) | 114.117.019 | (159.562.278) |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes) | 742.261 | (11.794) | 6.891.526 | 524.902 |
| | 38.781.270 | (9.484.908) | 121.008.545 | (159.037.376) |
| Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 10.878.844 | (89.765.536) | 61.142.662 | (245.259.988) |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

| | Sustainable Asia High Yield | | Sustainable Emerging Market Corporate Debt | |
|--|-----------------------------|---------------------|--|---------------------|
| | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen | | | | |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen | (2.256.424) | (16.823.821) | (3.653.040) | (17.600.215) |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust) | (296) | 31.808 | (66.913) | (91.884) |
| | (2.256.720) | (16.792.013) | (3.719.953) | (17.692.099) |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen | 1.626.567 | (1.727.278) | 8.342.056 | (11.214.596) |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes) | (71) | 97 | 132.111 | 27.411 |
| | 1.626.496 | (1.727.181) | 8.474.167 | (11.187.185) |
| Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | (630.224) | (18.519.194) | 4.754.214 | (28.879.284) |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

| | Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency ² | | Tactical Macro ¹ |
|--|---|-------------------|-----------------------------|
| | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2023 |
| | US\$ | US\$ | US\$ |
| Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen | | | |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen | (27.069.296) | (9.025.413) | 491.415 |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust) | (326.864) | (406.646) | (17.348) |
| | (27.396.160) | (9.432.059) | 474.067 |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen | 50.768.827 | (12.332.378) | 136.401 |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes) | 2.287.533 | 55.337 | (2.219) |
| | 53.056.360 | (12.277.041) | 134.182 |
| Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 25.660.200 | (21.709.100) | 608.249 |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

| | Ultra Short Term Euro Bond | | Uncorrelated Strategies | |
|--|----------------------------|-------------------|-------------------------|-------------------|
| | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
| | EUR | EUR | US\$ | US\$ |
| Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen | | | | |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen | (20.393.493) | (1.942.400) | 24.004.335 | (176.067.661) |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust) | (2.536) | 140.647 | (2.592.765) | (77.274.408) |
| | (20.396.029) | (1.801.753) | 21.411.570 | (253.342.069) |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen | 58.327.536 | (76.204.998) | (132.790.013) | 258.005.909 |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes) | (478) | (139.352) | (9.003.026) | 73.007.817 |
| | 58.327.058 | (76.344.350) | (141.793.039) | 331.013.726 |
| Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 37.931.029 | (78.146.103) | (120.381.469) | 77.671.657 |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

| | Uncorrelated Trading* | | US Equity | |
|--|-----------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen | | | | |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen | 38.237.119 | (48.728.968) | (1.250.349) | (2.458.372) |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust) | 5.955.369 | (3.955.039) | (795) | (10.548) |
| | 44.192.488 | (52.684.007) | (1.251.144) | (2.468.920) |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen | (59.155.154) | 59.155.154 | 10.370.420 | (2.885.247) |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes) | 2.274.940 | (2.300.520) | 3.038 | – |
| | (56.880.214) | 56.854.634 | 10.373.458 | (2.885.247) |
| Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | (12.687.726) | 4.170.627 | 9.122.314 | (5.354.167) |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

* Der Uncorrelated Trading wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst. Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) entstanden ausschließlich aus eingestellter Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

| | US Equity Index PutWrite | | US Large Cap Value | |
|--|--------------------------|-------------------|--------------------|-------------------|
| | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen | | | | |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen | 89.267.388 | (94.218.578) | (24.835.964) | (76.150.017) |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust) | (109.858) | (78.841) | (177.799) | (883.489) |
| | 89.157.530 | (94.297.419) | (25.013.763) | (77.033.506) |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen | 18.479.312 | 6.625.073 | (46.789.502) | 49.637.130 |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes) | (315) | 144 | (1.747) | 1.102 |
| | 18.478.997 | 6.625.217 | (46.791.249) | 49.638.232 |
| Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 107.636.527 | (87.672.202) | (71.805.012) | (27.395.274) |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

| | US Long Short Equity | | US Multi Cap Opportunities | |
|--|----------------------|-------------------|----------------------------|-------------------|
| | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen | | | | |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen | 4.533.923 | 21.917.080 | 39.332.501 | 44.244.243 |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust) | (8.186) | (32.867) | (702) | 1.515 |
| | 4.525.737 | 21.884.213 | 39.331.799 | 44.245.758 |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen | 22.537.173 | (58.748.168) | 30.693.036 | (194.265.895) |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes) | 38.528 | 18.987 | 108 | 468 |
| | 22.575.701 | (58.729.181) | 30.693.144 | (194.265.427) |
| Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 27.101.438 | (36.844.968) | 70.024.943 | (150.019.669) |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

| | US Real Estate Securities | | US Small Cap | |
|--|---------------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen | | | | |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen | (63.830.929) | 10.997.795 | (8.421.635) | 44.417.166 |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust) | (2.165) | (22.220) | (26.746) | (94.020) |
| | (63.833.094) | 10.975.575 | (8.448.381) | 44.323.146 |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen | 104.804.373 | (312.649.923) | 94.608.303 | (199.642.072) |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes) | (52) | 952 | 1.970 | (56.422) |
| | 104.804.321 | (312.648.971) | 94.610.273 | (199.698.494) |
| Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 40.971.227 | (301.673.396) | 86.161.892 | (155.375.348) |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

| | US Small Cap Intrinsic Value | |
|--|------------------------------|---------------------|
| | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ |
| Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen | | |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen | 7.330.787 | 3.124.694 |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust) | (3.585) | (2.359) |
| | 7.327.202 | 3.122.335 |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen | 26.969.758 | (42.314.194) |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes) | 170 | 218 |
| | 26.969.928 | (42.313.976) |
| Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 34.297.130 | (39.191.641) |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

¹ Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

² Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN

In Verfolgung seiner Anlageziele investiert der Fonds mit dem Ziel der Risikostreuung in übertragbare Wertpapiere. Durch die Anlage in Aktien und festverzinslichen Wertpapieren ergeben sich verschiedene Risiken für den Fonds, u. a. Markt-, Liquiditäts- und Kredit-/Gegenparteirisiken. Eine Darstellung der verschiedenen Risiken und der Strategien des Risikomanagements wird weiter unten gegeben. Zudem können die Folgen politischer, sozialer, wirtschaftlicher und diplomatischer Veränderungen oder der Zustand des Gesundheitswesens eine störende Wirkung auf die Marktpreise oder fairen Bewertungen von ausländischen Anlagen haben. Der beizulegende Zeitwert wird nach der in der Beschreibung der wesentlichen Bilanzierungsgrundsätze umrissenen Methode ermittelt. Die Aufstellungen des Wertpapierbestands der Portfolios zum Ende des Geschäftsjahres sind repräsentativ für die im Geschäftsjahr gehaltenen Anlageformen.

Marktrisiko

Das Marktrisiko verkörpert das Potenzial für sowohl Verluste als auch Gewinne und beinhaltet das Preisrisiko, das Zinsrisiko und das Fremdwährungsrisiko.

Alle Wertpapieranlagen unterliegen dem Risiko eines Kapitalverlustes. Der Manager und der Sub-Investment-Manager mindern dieses Risiko durch eine sorgfältige Auswahl der Wertpapiere und sonstigen Finanzinstrumente innerhalb vorgegebener Grenzen. Die gesamten Marktpositionen des Fonds werden vom Manager des Portfolios auf täglicher Basis überwacht und vierteljährlich von den Direktoren überprüft. Die Dividendenpapiere und Schuldtitel und zu Handelszwecken gehaltenen derivativen Finanzinstrumente des Fonds unterliegen einem Marktpreisänderungsrisiko, das sich aus der Ungewissheit hinsichtlich der künftigen Kursentwicklung der Instrumente ergibt.

(a) Preisänderungsrisiko

Das Preisänderungsrisiko ist das Risiko, dass die beizulegenden Zeitwerte von Wertpapieren infolge von Änderungen in den Indexständen und den Werten einzelner Wertpapiere fallen. Das Risikoexposure in Bezug auf den Handelspreis entsteht durch die Anlageportfolios des Fonds.

Der Großteil der Anlagen des Fonds ist gemäß Angabe im Verkaufsprospekt an anerkannten Börsen notiert oder wird an regulierten Märkten gehandelt. Zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 hätte ein 10%iger Anstieg der Wertpapierkurse einen Anstieg des Nettovermögens und der Veränderungen des Nettovermögens eines jeden Portfolios wie in der nachstehenden Tabelle aufgeführt zur Folge gehabt. Eine entgegengesetzte Änderung in gleicher Höhe hätte zu einer Abnahme des Nettovermögens in gleicher Höhe geführt.

| Portfolio | Währung | 31. Dezember 2023 | % des Nettovermögens | 31. Dezember 2022 | % des Nettovermögens |
|---|---------|-------------------|----------------------|-------------------|----------------------|
| 5G Connectivity | USD | 99.582.421 | 9,54 % | 96.175.643 | 9,69 % |
| Absolute Return Multi Strategy* | USD | 631 | 0,00 % | 677 | 0,00 % |
| China A-Share Equity | CNY | 1.348.094 | 9,48 % | 1.531.769 | 9,43 % |
| China Bond | CNY | 44.475.518 | 9,69 % | 42.634.573 | 9,41 % |
| China Equity | USD | 17.204.023 | 9,65 % | 30.713.184 | 9,68 % |
| Climate Innovation ¹ | USD | 283.140 | 9,69 % | – | – |
| CLO Income | USD | 17.672.631 | 9,52 % | 11.481.421 | 8,32 % |
| Commodities ² | USD | 12.233.622 | 7,96 % | 7.739.442 | 9,00 % |
| Corporate Hybrid Bond | EUR | 175.890.908 | 9,41 % | 162.716.118 | 9,13 % |
| Developed Market FMP – 2027 ¹ | USD | 13.581.666 | 9,88 % | – | – |
| Emerging Market Debt - Hard Currency | USD | 257.273.790 | 9,71 % | 233.467.771 | 9,37 % |
| Emerging Market Debt - Local Currency | USD | 121.669.557 | 9,46 % | 130.283.522 | 9,40 % |
| Emerging Market Debt Blend | USD | 49.557.893 | 9,41 % | 44.932.225 | 9,56 % |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | USD | 6.082.402 | 9,35 % | 5.035.590 | 9,28 % |
| Emerging Markets Equity | USD | 8.826.906 | 9,73 % | 18.912.096 | 9,86 % |
| Emerging Markets Select Equity** | USD | – | – | 9.042.698 | 9,64 % |
| Euro Bond | EUR | 1.013.836 | 9,59 % | 847.795 | 9,12 % |
| Euro Bond Absolute Return | EUR | 3.177.057 | 9,34 % | 4.624.076 | 9,53 % |
| European High Yield Bond | EUR | 38.635.380 | 9,46 % | 3.062.817 | 9,44 % |
| European Sustainable Equity | EUR | 17.122.579 | 9,95 % | 17.438.883 | 9,92 % |
| Event Driven ² | USD | 11.990.183 | 9,48 % | 3.474.117 | 8,38 % |
| Global Bond | USD | 10.728.468 | 9,87 % | 13.167.283 | 9,77 % |
| Global Diversified Income FMP – 2024 | USD | 14.423.960 | 9,23 % | 15.479.144 | 9,65 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

| Portfolio | Währung | 31. Dezember 2023 | % des Nettovermögens | 31. Dezember 2022 | % des Nettovermögens |
|---|---------|-------------------|----------------------|-------------------|----------------------|
| Global Equity Megatrends | USD | 14.149.305 | 9,79 % | 7.946.534 | 10,02 % |
| Global Flexible Credit Income | USD | 35.947.816 | 9,20 % | 37.314.259 | 9,46 % |
| Global High Yield SDG Engagement | USD | 53.770.185 | 9,63 % | 27.747.950 | 8,23 % |
| Global High Yield Sustainable Action*** | USD | – | – | 1.418.914 | 9,43 % |
| Global Investment Grade Credit | USD | 8.235.244 | 9,49 % | 8.189.868 | 9,53 % |
| Global Opportunistic Bond | USD | 6.290.059 | 9,62 % | 7.458.139 | 9,80 % |
| Global Real Estate Securities | USD | 2.025.945 | 9,90 % | 3.792.511 | 9,72 % |
| Global Sustainable Equity | USD | 15.360.342 | 9,94 % | 13.052.448 | 9,92 % |
| Global Sustainable Value | USD | 5.494.503 | 9,91 % | 4.775.068 | 9,94 % |
| High Yield Bond | USD | 211.826.233 | 9,41 % | 214.442.381 | 9,33 % |
| InnovAsia 5G | USD | 2.276.389 | 9,58 % | 1.424.712 | 9,66 % |
| Japan Equity Engagement | JPY | 1.604.837.483 | 9,92 % | 2.011.077.140 | 9,79 % |
| Macro Opportunities FX | EUR | 276.814 | 9,61 % | 3.132.477 | 9,94 % |
| Multi-Asset Income**** | USD | – | – | 858.422 | 7,55 % |
| Next Generation Mobility | USD | 15.282.479 | 9,30 % | 13.848.098 | 9,36 % |
| Next Generation Space Economy ² | USD | 1.867.472 | 9,46 % | 798.167 | 9,40 % |
| Responsible Asian Debt - Hard Currency | USD | 6.033.418 | 9,44 % | 2.017.434 | 9,33 % |
| Short Duration Emerging Market Debt | USD | 387.324.439 | 9,79 % | 487.580.603 | 9,51 % |
| Short Duration High Yield SDG Engagement | USD | 68.981.565 | 9,27 % | 53.097.443 | 9,54 % |
| Strategic Income | USD | 213.789.986 | 10,59 % | 144.106.190 | 10,89 % |
| Sustainable Asia High Yield | USD | 2.685.127 | 9,40 % | 2.859.917 | 8,96 % |
| Sustainable Emerging Market Corporate Debt | USD | 9.209.439 | 9,42 % | 9.214.528 | 9,38 % |
| Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency ² | USD | 42.646.780 | 9,56 % | 14.670.976 | 9,26 % |
| Tactical Macro ¹ | USD | 2.316.731 | 8,53 % | – | – |
| Ultra Short Term Euro Bond | EUR | 95.746.144 | 9,64 % | 79.837.235 | 9,72 % |
| Uncorrelated Strategies | USD | 97.630.396 | 6,00 % | 206.595.785 | 6,60 % |
| Uncorrelated Trading ^{2*****} | USD | – | – | 53.936.721 | 7,58 % |
| US Equity | USD | 4.700.718 | 9,55 % | 2.909.518 | 9,25 % |
| US Equity Index PutWrite | USD | 66.969.604 | 9,19 % | 63.457.321 | 9,33 % |
| US Large Cap Value | USD | 185.257.981 | 9,55 % | 168.949.697 | 9,56 % |
| US Long Short Equity | USD | 17.344.585 | 8,87 % | 17.625.383 | 7,96 % |
| US Multi Cap Opportunities | USD | 39.850.146 | 9,95 % | 44.117.461 | 10,00 % |
| US Real Estate Securities | USD | 52.190.980 | 9,79 % | 62.739.110 | 9,68 % |
| US Small Cap | USD | 62.290.214 | 9,83 % | 57.949.243 | 9,78 % |
| US Small Cap Intrinsic Value | USD | 30.173.640 | 9,38 % | 18.688.937 | 9,63 % |

* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

** Das Portfolio wurde am 7. September 2023 aufgelöst.

*** Das Portfolio wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

**** Das Portfolio wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

***** Das Portfolio wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

¹ Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

² Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Das sonstige Preisrisiko ist das Risiko, dass sich der Wert der Finanzinstrumente aufgrund von Marktpreisschwankungen (mit Ausnahme solcher, die von Zinsänderungs- oder Währungsrisiken hervorgerufen werden) verändert, sei es, dass diese Änderungen spezifischen Faktoren eines einzelnen Instruments oder seinem Emittenten zuzuordnen sind, oder dass sich alle Faktoren auf alle am Markt gehandelten Instrumente auswirken. Da der Großteil der Finanzinstrumente des Fonds zum beizulegenden Zeitwert ausgewiesen und die Veränderungen des beizulegenden Zeitwerts in der Gewinn- und Verlustrechnung erfasst werden, wirken sich Veränderungen der Marktbedingungen unmittelbar auf den Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten aus.

Das Preisrisiko wird durch den Manager gesteuert, indem er in ein diversifiziertes Spektrum von Wertpapieren auf verschiedenen Märkten investiert.

In den nachstehenden Tabellen sind die Preisrisiken der betreffenden Portfolios insgesamt zusammengefasst.

| 5G Connectivity | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|---|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien: | | | | |
| Chinesischer Yuan Renminbi | 2.360.602 | 0,23 | 88.330.793 | 8,15 |
| Euro | 81.417.322 | 7,80 | 61.082.055 | 6,15 |
| Hongkong-Dollar | – | – | 19.691.830 | 1,98 |
| Japanischer Yen | 102.820.574 | 9,85 | 92.855.794 | 9,35 |
| Neuer taiwanesischer Dollar | 90.475.913 | 8,67 | 46.686.340 | 4,70 |
| Südkoreanischer Won | 26.816.617 | 2,57 | 7.609.911 | 0,77 |
| US-Dollar | 686.624.280 | 65,80 | 636.637.996 | 64,11 |
| | 990.515.308 | 94,92 | 952.894.719 | 95,96 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | 5.308.901 | 0,51 | 8.861.706 | 0,89 |

| Absolute Return Multi Strategy* | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|----------------------------------|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien: | | | | |
| US-Dollar | 6.311 | 0,00 | 6.766 | 0,00 |
| | 6.311 | 0,00 | 6.766 | 0,00 |

* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

| China A-Share Equity | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|----------------------------------|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert CNY | % des Netto- vermögens | Marktwert CNY | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien: | | | | |
| Chinesischer Yuan Renminbi | 11.693.754 | 82,27 | 14.345.271 | 88,32 |
| Hongkong-Dollar | 1.787.183 | 12,57 | 972.422 | 5,99 |
| | 13.480.937 | 94,84 | 15.317.693 | 94,31 |

| China Bond | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|---|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert CNY | % des Netto- vermögens | Marktwert CNY | % des Netto- vermögens |
| Zu Handelszwecken gehaltene Einlagezertifikate: | | | | |
| Chinesischer Yuan Renminbi | 58.557.000 | 12,76 | 88.103.380 | 19,45 |
| US-Dollar | – | – | 4.820.965 | 1,07 |
| | 58.557.000 | 12,76 | 92.924.345 | 20,52 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

| China Bond (Fortsetzung) | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert CNY | % des Netto- vermögens | Marktwert CNY | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: | | | | |
| Chinesischer Yuan Renminbi | 176.348.979 | 38,43 | 163.677.183 | 36,13 |
| US-Dollar | 113.805.135 | 24,81 | 108.488.656 | 23,94 |
| | 290.154.114 | 63,24 | 272.165.839 | 60,07 |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen: | | | | |
| Chinesischer Yuan Renminbi | 95.858.682 | 20,89 | 60.073.670 | 13,26 |
| | 444.569.796 | 96,89 | 425.163.854 | 93,85 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | 185.388 | 0,04 | 1.181.877 | 0,26 |

| China Equity | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|---|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien: | | | | |
| Chinesischer Yuan Renminbi | 74.424.135 | 41,76 | 130.092.894 | 40,98 |
| Hongkong-Dollar | 76.902.453 | 43,15 | 163.724.575 | 51,58 |
| US-Dollar | 20.589.763 | 11,55 | 13.032.219 | 4,11 |
| | 171.916.351 | 96,46 | 306.849.688 | 96,67 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | 123.876 | 0,07 | 282.149 | 0,09 |

| Climate Innovation ¹ | 31. Dezember 2023 | |
|----------------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien: | | |
| Chinesischer Yuan Renminbi | 22.928 | 0,78 |
| Euro | 423.545 | 14,49 |
| Hongkong-Dollar | 106.861 | 3,66 |
| Japanischer Yen | 86.566 | 2,96 |
| Norwegische Krone | 7.036 | 0,24 |
| Britisches Pfund | 91.036 | 3,12 |
| Südkoreanischer Won | 228.261 | 7,81 |
| Schweizer Franken | 59.474 | 2,04 |
| US-Dollar | 1.805.691 | 61,78 |
| | 2.831.398 | 96,88 |

¹ Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

| CLO Income | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|---|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Schatzwechsel: | | | | |
| US-Dollar | 4.994.906 | 2,69 | – | – |
| Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen): | | | | |
| Euro | 51.280.871 | 27,62 | 9.941.110 | 7,20 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

| CLO Income (Fortsetzung) | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) (Fortsetzung): | | | | |
| US-Dollar | 108.406.204 | 58,40 | 102.929.843 | 74,57 |
| | 159.687.075 | 86,02 | 112.870.953 | 81,77 |
| Für den Handel gehaltene Investmentfonds: | | | | |
| US-Dollar | 12.221.060 | 6,58 | – | – |
| | 176.903.041 | 95,29 | 112.870.953 | 81,77 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | (176.733) | (0,09) | 1.943.252 | 1,41 |

| Commodities ² | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Schatzwechsel: | | | | |
| US-Dollar | 43.941.161 | 28,60 | 39.453.874 | 45,88 |
| | 43.941.161 | 28,60 | 39.453.874 | 45,88 |
| Für den Handel gehaltene Agency Bonds: | | | | |
| US-Dollar | – | – | 10.530.836 | 12,25 |
| | – | – | 10.530.836 | 12,25 |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: | | | | |
| US-Dollar | 77.031.796 | 50,14 | 26.223.262 | 30,49 |
| | 120.972.957 | 78,74 | 76.207.972 | 88,62 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | 1.363.262 | 0,88 | 1.186.450 | 1,38 |

² Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

| Corporate Hybrid Bond | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|---|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert EUR | % des Netto- vermögens | Marktwert EUR | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: | | | | |
| Euro | 1.095.380.852 | 58,58 | 1.059.438.369 | 59,45 |
| Britisches Pfund | 430.873.063 | 23,05 | 358.590.800 | 20,12 |
| US-Dollar | 217.329.710 | 11,62 | 219.972.176 | 12,34 |
| | 1.743.583.625 | 93,25 | 1.638.001.345 | 91,91 |
| Für den Handel gehaltene Investmentfonds: | | | | |
| US-Dollar | 10.956.412 | 0,59 | 10.317.170 | 0,58 |
| | 1.754.540.037 | 93,84 | 1.648.318.515 | 92,49 |
| Reverse Repurchase Agreements held for trading (Fortsetzung): | – | – | (37.445.575) | (2,10) |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | 4.369.046 | 0,23 | 16.288.239 | 0,91 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Developed Market FMP – 2027¹

| | 31. Dezember 2023 | |
|--|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: | | |
| US-Dollar | 135.777.186 | 98,78 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | 39.476 | 0,03 |

¹ Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

Emerging Market Debt - Hard Currency

| | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: | | | | |
| Euro | 22.351.770 | 0,84 | 14.662.054 | 0,59 |
| US-Dollar | 710.090.994 | 26,80 | 770.315.416 | 30,91 |
| | 732.442.764 | 27,64 | 784.977.470 | 31,50 |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen: | | | | |
| Euro | 457.638.482 | 17,27 | 368.795.821 | 14,80 |
| US-Dollar | 1.336.544.120 | 50,44 | 1.139.225.120 | 45,72 |
| | 1.794.182.602 | 67,71 | 1.508.020.941 | 60,52 |
| Für den Handel gehaltene Investmentfonds: | | | | |
| US-Dollar | 17.580.000 | 0,66 | 16.110.000 | 0,65 |
| | 2.544.205.366 | 96,01 | 2.309.108.411 | 92,67 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | 28.532.535 | 1,08 | 25.569.299 | 1,03 |

Emerging Market Debt - Local Currency

| | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|---|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Zu Handelszwecken gehaltene Einlagezertifikate: | | | | |
| Chinesischer Yuan Renminbi | – | – | 18.492.177 | 1,34 |
| | – | – | 18.492.177 | 1,34 |
| Für den Handel gehaltene Schatzwechsel: | | | | |
| Thailändischer Baht | 7.548.955 | 0,59 | – | – |
| US-Dollar | 25.792.195 | 2,00 | – | – |
| | 33.341.150 | 2,59 | – | – |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: | | | | |
| Chinesischer Yuan Renminbi | 11.270.480 | 0,88 | 7.285.480 | 0,52 |
| Kolumbianischer Peso | 21.548.196 | 1,67 | 8.802.670 | 0,64 |
| Mexikanischer Peso | 9.006.924 | 0,70 | 6.380.573 | 0,46 |
| | 41.825.600 | 3,25 | 22.468.723 | 1,62 |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen: | | | | |
| Chilenischer Peso | 27.343.613 | 2,13 | 26.104.583 | 1,88 |
| Chinesischer Yuan Renminbi | 82.382.352 | 6,41 | 102.801.260 | 7,42 |
| Kolumbianischer Peso | 94.999.458 | 7,39 | 74.598.060 | 5,38 |
| Tschechische Krone | 63.651.804 | 4,95 | 73.521.592 | 5,30 |
| Peso Dominikanische Republik | 6.712.333 | 0,52 | 2.610.187 | 0,19 |
| Ghanaischer Cedi | 1.739.991 | 0,14 | 4.108.737 | 0,30 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

| | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen (Fortsetzung): | | | | |
| Ungarischer Forint | 35.686.547 | 2,77 | 5.996.791 | 0,43 |
| Indonesische Rupiah | 134.059.168 | 10,43 | 137.097.295 | 9,89 |
| Japanischer Yen | 24.384 | 0,00 | 32.421 | 0,00 |
| Malaysischer Ringgit | 117.086.678 | 9,11 | 139.277.177 | 10,05 |
| Mexikanischer Peso | 107.932.218 | 8,39 | 144.597.744 | 10,43 |
| Peruanischer Sol | 38.254.182 | 2,97 | 33.296.058 | 2,40 |
| Philippinischer Peso | 4.998.061 | 0,39 | – | – |
| Polnischer Zloty | 123.314.997 | 9,59 | 124.542.085 | 8,98 |
| Rumänischer neuer Leu | 40.252.372 | 3,13 | 55.708.597 | 4,02 |
| Serbischer Dinar | 3.648.955 | 0,28 | 4.872.169 | 0,35 |
| Südafrikanischer Rand | 122.163.844 | 9,50 | 178.596.837 | 12,88 |
| Thailändischer Baht | 65.015.458 | 5,06 | 125.927.439 | 9,08 |
| Türkische Lira | 20.116.212 | 1,56 | 18.929.286 | 1,37 |
| Uganda-Schilling | 5.747.019 | 0,45 | 7.306.313 | 0,53 |
| US-Dollar | 10.942.954 | 0,85 | 15.066.161 | 1,09 |
| Uruguayischer Peso | 13.856.086 | 1,08 | 2.636.726 | 0,19 |
| Sambischer Kwacha | 4.493.148 | 0,35 | 2.725.498 | 0,20 |
| | 1.124.421.834 | 87,45 | 1.280.353.016 | 92,36 |
| Für den Handel gehaltene Investmentfonds: | | | | |
| US-Dollar | 16.173.300 | 1,26 | 15.136.550 | 1,09 |
| | 1.215.761.884 | 94,55 | 1.336.450.466 | 96,41 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | 933.685 | 0,07 | (33.615.251) | (2,42) |

Emerging Market Debt Blend

| | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Schatzwechsel: | | | | |
| Thailändischer Baht | 1.006.392 | 0,19 | – | – |
| | 1.006.392 | 0,19 | – | – |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: | | | | |
| Kolumbianischer Peso | 6.891.239 | 1,31 | 3.398.251 | 0,72 |
| Euro | 1.831.160 | 0,35 | 1.032.323 | 0,22 |
| Mexikanischer Peso | 5.189.750 | 0,98 | 4.264.869 | 0,91 |
| US-Dollar | 134.165.703 | 25,47 | 141.206.810 | 30,03 |
| | 148.077.852 | 28,11 | 149.902.253 | 31,88 |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen: | | | | |
| Chilenischer Peso | 3.606.443 | 0,69 | 2.895.335 | 0,61 |
| Chinesischer Yuan Renminbi | 18.928.714 | 3,59 | 15.427.534 | 3,28 |
| Kolumbianischer Peso | 20.288.878 | 3,85 | 12.577.245 | 2,67 |
| Tschechische Krone | 15.841.841 | 3,01 | 11.315.314 | 2,41 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

| | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen (Fortsetzung): | | | | |
| Peso Dominikanische Republik | 1.455.729 | 0,28 | 624.770 | 0,13 |
| Euro | 20.709.235 | 3,93 | 17.857.261 | 3,80 |
| Ghanaischer Cedi | 357.466 | 0,07 | 815.776 | 0,17 |
| Ungarischer Forint | 7.575.290 | 1,44 | 616.714 | 0,13 |
| Indonesische Rupiah | 29.206.946 | 5,54 | 22.600.787 | 4,81 |
| Malaysischer Ringgit | 24.205.015 | 4,60 | 22.744.336 | 4,84 |
| Mexikanischer Peso | 21.666.362 | 4,11 | 21.682.994 | 4,61 |
| Peruanischer Sol | 10.024.733 | 1,90 | 7.750.139 | 1,65 |
| Philippinischer Peso | 1.105.103 | 0,21 | – | – |
| Polnischer Zloty | 26.622.990 | 5,05 | 24.290.359 | 5,17 |
| Rumänischer neuer Leu | 8.334.386 | 1,58 | 8.837.453 | 1,88 |
| Serbischer Dinar | 790.524 | 0,15 | 873.537 | 0,19 |
| Südafrikanischer Rand | 26.084.532 | 4,95 | 27.262.285 | 5,80 |
| Thailändischer Baht | 17.287.737 | 3,28 | 20.529.539 | 4,37 |
| Türkische Lira | 4.286.125 | 0,81 | 3.313.333 | 0,70 |
| Uganda-Schilling | 1.119.625 | 0,21 | 1.090.644 | 0,23 |
| US-Dollar | 66.534.442 | 12,63 | 63.974.006 | 13,61 |
| Uruguayischer Peso | 2.815.790 | 0,54 | 600.568 | 0,13 |
| Sambischer Kwacha | 1.720.200 | 0,33 | 432.664 | 0,09 |
| | 330.568.106 | 62,75 | 288.112.593 | 61,28 |
| Für den Handel gehaltene Investmentfonds: | | | | |
| US-Dollar | 14.297.035 | 2,72 | 13.380.558 | 2,84 |
| | 493.949.385 | 93,77 | 451.395.404 | 96,00 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | 1.629.543 | 0,31 | (2.073.158) | (0,44) |

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

| | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Schatzwechsel: | | | | |
| Thailändischer Baht | 37.793 | 0,06 | – | – |
| US-Dollar | 783.358 | 1,20 | – | – |
| | 821.151 | 1,26 | – | – |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: | | | | |
| Kolumbianischer Peso | 167.215 | 0,26 | – | – |
| Euro | 85.072 | 0,13 | 81.235 | 0,15 |
| Mexikanischer Peso | 48.823 | 0,08 | – | – |
| US-Dollar | 8.938.496 | 13,73 | 7.430.806 | 13,69 |
| | 9.239.606 | 14,20 | 7.512.041 | 13,84 |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen: | | | | |
| Chilenischer Peso | 369.265 | 0,57 | 375.653 | 0,69 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend (Fortsetzung) | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|---|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen (Fortsetzung): | | | | |
| Chinesischer Yuan Renminbi | – | – | 2.031.464 | 3,74 |
| Kolumbianischer Peso | 1.612.874 | 2,48 | 801.082 | 1,48 |
| Tschechische Krone | 1.120.980 | 1,72 | 883.384 | 1,63 |
| Euro | 15.173.869 | 23,32 | 12.310.300 | 22,68 |
| Ungarischer Forint | 789.996 | 1,21 | 207.182 | 0,38 |
| Indonesische Rupiah | 3.393.637 | 5,21 | 2.265.664 | 4,17 |
| Malaysischer Ringgit | 2.375.155 | 3,65 | 2.105.774 | 3,88 |
| Mexikanischer Peso | 3.218.001 | 4,95 | 2.684.300 | 4,95 |
| Peruanischer Sol | 572.240 | 0,88 | 284.758 | 0,53 |
| Philippinischer Peso | 86.705 | 0,13 | – | – |
| Polnischer Zloty | 1.877.970 | 2,89 | 1.308.790 | 2,41 |
| Rumänischer neuer Leu | 821.386 | 1,26 | 718.745 | 1,32 |
| Thailändischer Baht | 1.903.738 | 2,93 | 1.580.752 | 2,91 |
| US-Dollar | 14.720.671 | 22,63 | 14.709.282 | 27,10 |
| Uruguayischer Peso | 230.078 | 0,35 | 18.744 | 0,04 |
| | 48.266.565 | 74,18 | 42.285.874 | 77,91 |
| | 58.327.322 | 89,64 | 49.797.915 | 91,75 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | 2.496.697 | 3,84 | 557.983 | 1,03 |

| Emerging Markets Equity | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|----------------------------------|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien: | | | | |
| Brasilianischer Real | 4.893.129 | 5,39 | 7.583.703 | 3,95 |
| Kanadischer Dollar | 527.363 | 0,58 | 1.690.432 | 0,88 |
| Chinesischer Yuan Renminbi | 4.639.922 | 5,12 | 22.324.279 | 11,64 |
| Hongkong-Dollar | 10.314.095 | 11,37 | 37.055.894 | 19,32 |
| Ungarischer Forint | 1.548.368 | 1,71 | 2.147.576 | 1,12 |
| Indische Rupie | 16.879.717 | 18,61 | 32.046.728 | 16,71 |
| Indonesische Rupiah | 1.597.980 | 1,76 | 2.888.935 | 1,51 |
| Mexikanischer Peso | 2.453.962 | 2,71 | 2.870.110 | 1,50 |
| Neuer taiwanesischer Dollar | 6.570.941 | 7,25 | 11.740.474 | 6,12 |
| Philippinischer Peso | 1.641.571 | 1,81 | – | – |
| Polnischer Zloty | 986.834 | 1,09 | 2.615.773 | 1,36 |
| Britisches Pfund | 2.327.741 | 2,57 | 4.132.511 | 2,15 |
| Katar-Rial | – | – | 1.894.532 | 0,99 |
| Saudi-Arabischer Riyal | 3.794.106 | 4,18 | 6.654.852 | 3,47 |
| Südafrikanischer Rand | 1.094.907 | 1,21 | 5.910.698 | 3,08 |
| Südkoreanischer Won | 10.425.157 | 11,50 | 21.051.735 | 10,98 |
| Thailändischer Baht | 846.746 | 0,93 | 992.701 | 0,52 |
| VAE-Dirham | 1.522.134 | 1,68 | 2.750.497 | 1,43 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

| Emerging Markets Equity (Fortsetzung) | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen (Fortsetzung): | | | | |
| US-Dollar | 15.238.027 | 16,80 | 22.382.576 | 11,67 |
| | 87.302.700 | 96,27 | 188.734.006 | 98,40 |
| Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften: | | | | |
| Mexikanischer Peso | 481.105 | 0,53 | – | – |
| | 87.783.805 | 96,80 | 188.734.006 | 98,40 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | 485.257 | 0,53 | 386.954 | 0,20 |

| Emerging Markets Select Equity* | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|----------------------------------|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien: | | | | |
| Brasilianischer Real | – | – | 2.793.292 | 2,98 |
| Chinesischer Yuan Renminbi | – | – | 9.457.406 | 10,09 |
| Hongkong-Dollar | – | – | 19.787.346 | 21,10 |
| Indische Rupie | – | – | 7.608.229 | 8,11 |
| Indonesische Rupiah | – | – | 2.132.626 | 2,27 |
| Mexikanischer Peso | – | – | 1.624.815 | 1,73 |
| Neuer taiwanesischer Dollar | – | – | 13.804.257 | 14,72 |
| Polnischer Zloty | – | – | 1.515.194 | 1,62 |
| Britisches Pfund | – | – | 1.390.895 | 1,48 |
| Katar-Rial | – | – | 1.034.075 | 1,10 |
| Saudi-Arabischer Riyal | – | – | 1.404.943 | 1,50 |
| Südafrikanischer Rand | – | – | 3.006.465 | 3,21 |
| Südkoreanischer Won | – | – | 11.727.350 | 12,51 |
| Thailändischer Baht | – | – | 756.239 | 0,81 |
| VAE-Dirham | – | – | 1.362.386 | 1,45 |
| US-Dollar | – | – | 11.021.461 | 11,76 |
| | – | – | 90.426.979 | 96,44 |

* Das Portfolio wurde am 7. September 2023 aufgelöst.

| Euro Bond | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|---|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert EUR | % des Netto- vermögens | Marktwert EUR | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen): | | | | |
| Euro | 4.100 | 0,04 | 462.816 | 4,98 |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: | | | | |
| Euro | 4.770.071 | 45,11 | 4.079.176 | 43,88 |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen: | | | | |
| Euro | 5.399.389 | 51,07 | 4.005.023 | 43,09 |
| | 10.173.560 | 96,22 | 8.547.015 | 91,95 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | (35.197) | (0,33) | (69.064) | (0,74) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

| Euro Bond Absolute Return | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|---|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert EUR | % des Netto- vermögens | Marktwert EUR | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen): | | | | |
| Euro | 158.727 | 0,46 | 2.319.216 | 4,78 |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: | | | | |
| Dänische Krone | 1.314.538 | 3,86 | 995.767 | 2,05 |
| Euro | 17.243.626 | 50,68 | 22.942.484 | 47,28 |
| | 18.558.164 | 54,54 | 23.938.251 | 49,33 |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen: | | | | |
| Tschechische Krone | 400.377 | 1,18 | – | – |
| Euro | 13.029.635 | 38,29 | 19.650.553 | 40,49 |
| Polnischer Zloty | 1.026.138 | 3,02 | – | – |
| | 14.456.150 | 42,49 | 19.650.553 | 40,49 |
| | 33.173.041 | 97,49 | 45.908.020 | 94,60 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | (1.402.468) | (4,12) | 332.738 | 0,69 |

| European High Yield Bond | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|---|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert EUR | % des Netto- vermögens | Marktwert EUR | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen): | | | | |
| Euro | 2.200.101 | 0,54 | – | – |
| US-Dollar | 225.240 | 0,05 | 215.121 | 0,66 |
| | 2.425.341 | 0,59 | 215.121 | 0,66 |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: | | | | |
| Euro | 325.684.785 | 79,74 | 28.338.871 | 87,32 |
| Britisches Pfund | 58.748.951 | 14,39 | 3.726.129 | 11,48 |
| | 384.433.736 | 94,13 | 32.065.000 | 98,80 |
| Für den Handel gehaltene mittelfristige Schuldverschreibungen: | | | | |
| Euro | 114.727 | 0,03 | 202.519 | 0,63 |
| | 386.973.804 | 94,75 | 32.482.640 | 100,09 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | (620.006) | (0,15) | (1.854.475) | (5,72) |

| European Sustainable Equity | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|----------------------------------|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert EUR | % des Netto- vermögens | Marktwert EUR | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien: | | | | |
| Dänische Krone | 13.482.070 | 7,83 | 8.595.893 | 4,89 |
| Euro | 84.501.324 | 49,10 | 81.995.074 | 46,63 |
| Norwegische Krone | 5.211.834 | 3,03 | 7.133.274 | 4,06 |
| Britisches Pfund | 24.298.381 | 14,12 | 24.444.336 | 13,90 |
| Schwedische Krone | 10.498.731 | 6,10 | 13.773.588 | 7,83 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

European Sustainable Equity (Fortsetzung)

| | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert EUR | % des Netto- vermögens | Marktwert EUR | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien (Fortsetzung): | | | | |
| Schweizer Franken | 31.043.956 | 18,04 | 35.431.220 | 20,15 |
| US-Dollar | 2.189.494 | 1,27 | 3.015.442 | 1,71 |
| | 171.225.790 | 99,49 | 174.388.827 | 99,17 |

Event Driven²

| | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|---|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Schatzwechsel: | | | | |
| US-Dollar | 115.039.719 | 91,00 | 33.823.354 | 81,61 |
| | 115.039.719 | 91,00 | 33.823.354 | 81,61 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | 4.862.107 | 3,85 | 917.817 | 2,21 |

² Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

Global Bond

| | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|---|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Agency Bonds: | | | | |
| US-Dollar | 1.146.538 | 1,05 | 2.423.190 | 1,80 |
| Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen): | | | | |
| Euro | 2.971.034 | 2,73 | 2.228.563 | 1,65 |
| Britisches Pfund | 670.026 | 0,62 | 1.289.899 | 0,96 |
| US-Dollar | 7.223.446 | 6,64 | 5.343.245 | 3,96 |
| | 10.864.506 | 9,99 | 8.861.707 | 6,57 |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: | | | | |
| Kanadischer Dollar | – | – | 1.022.908 | 0,76 |
| Dänische Krone | 1.030.253 | 0,95 | – | – |
| Euro | 6.226.360 | 5,73 | 10.341.319 | 7,67 |
| Britisches Pfund | 1.678.151 | 1,54 | 1.763.306 | 1,31 |
| US-Dollar | 19.920.838 | 18,32 | 31.231.661 | 23,16 |
| | 28.855.602 | 26,54 | 44.359.194 | 32,90 |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen: | | | | |
| Australischer Dollar | 1.422.394 | 1,31 | 9.709 | 0,01 |
| Kanadischer Dollar | 2.436.049 | 2,24 | 10.329.838 | 7,66 |
| Euro | 18.727.042 | 17,22 | 9.397.938 | 6,97 |
| Indonesische Rupiah | 2.422.585 | 2,23 | 1.164.003 | 0,86 |
| Japanischer Yen | 4.550.365 | 4,19 | 5.959.363 | 4,42 |
| Mexikanischer Peso | 819.455 | 0,75 | 2.872.675 | 2,13 |
| Neuseeländischer Dollar | 682.094 | 0,63 | 1.604.915 | 1,19 |
| Polnischer Zloty | 302.813 | 0,28 | – | – |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

| Global Bond (Fortsetzung) | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen (Fortsetzung): | | | | |
| Britisches Pfund | 2.448.473 | 2,25 | 2.840.463 | 2,11 |
| Südkoreanischer Won | 2.429.774 | 2,23 | 5.630.012 | 4,18 |
| Schweizer Franken | 399.725 | 0,37 | – | – |
| US-Dollar | 5.840.805 | 5,37 | 13.861.093 | 10,28 |
| | 42.481.574 | 39,07 | 53.670.009 | 39,81 |
| Für den Handel gehaltene Mortgage-Backed Securities: | | | | |
| US-Dollar | 22.645.649 | 20,82 | 19.062.981 | 14,14 |
| Für den Handel gehaltene Kommunalanleihen: | | | | |
| US-Dollar | 1.278.776 | 1,18 | 1.706.806 | 1,27 |
| Für den Handel gehaltene Schatzwechsel: | | | | |
| US-Dollar | – | – | 791.814 | 0,59 |
| | 107.272.645 | 98,65 | 130.875.701 | 97,08 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | 12.036 | 0,01 | 797.126 | 0,59 |

| Global Diversified Income FMP – 2024 | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Schatzwechsel: | | | | |
| US-Dollar | 18.765.889 | 12,01 | – | – |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: | | | | |
| US-Dollar | 123.463.985 | 79,04 | 150.336.737 | 93,73 |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen: | | | | |
| US-Dollar | 1.727.993 | 1,11 | 3.931.136 | 2,45 |
| | 143.957.867 | 92,16 | 154.267.873 | 96,18 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | 281.732 | 0,18 | 523.570 | 0,33 |

| Global Equity Megatrends | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|---|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien: | | | | |
| Kanadischer Dollar | 5.599.812 | 3,88 | 4.945.150 | 6,23 |
| Britisches Pfund | 7.576.699 | 5,24 | 4.451.857 | 5,61 |
| US-Dollar | 128.316.090 | 88,81 | 70.068.328 | 88,31 |
| | 141.492.601 | 97,93 | 79.465.335 | 100,15 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | 444 | 0,00 | – | – |

| Global Flexible Credit Income | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|----------------------------------|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien: | | | | |
| US-Dollar | 6.022.083 | 1,54 | 5.247.334 | 1,33 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Global Flexible Credit Income (Fortsetzung)

| | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|---|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen): | | | | |
| US-Dollar | 23.118.219 | 5,92 | 24.079.041 | 6,10 |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: | | | | |
| Euro | 63.284.923 | 16,20 | 55.474.132 | 14,06 |
| Britisches Pfund | 10.735.064 | 2,75 | 10.688.891 | 2,71 |
| US-Dollar | 222.253.475 | 56,90 | 250.001.101 | 63,37 |
| | 296.273.462 | 75,85 | 316.164.124 | 80,14 |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen: | | | | |
| Euro | 1.992.091 | 0,51 | 1.976.528 | 0,50 |
| US-Dollar | 13.387.657 | 3,43 | 7.841.259 | 1,99 |
| | 15.379.748 | 3,94 | 9.817.787 | 2,49 |
| Für den Handel gehaltene mittelfristige Schuldverschreibungen: | | | | |
| US-Dollar | 15.105.874 | 3,87 | – | – |
| Für den Handel gehaltene Investmentfonds: | | | | |
| Britisches Pfund | 66.832 | 0,01 | 338.564 | 0,08 |
| | 355.966.218 | 91,13 | 355.646.850 | 90,14 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | 3.511.941 | 0,90 | 17.495.741 | 4,44 |

Global High Yield SDG Engagement

| | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: | | | | |
| Euro | 96.138.657 | 17,23 | 47.186.640 | 14,00 |
| Britisches Pfund | 17.609.057 | 3,14 | 6.749.530 | 2,01 |
| US-Dollar | 418.751.767 | 75,03 | 219.069.164 | 65,01 |
| | 532.499.481 | 95,40 | 273.005.334 | 81,02 |
| Für den Handel gehaltene mittelfristige Schuldverschreibungen: | | | | |
| US-Dollar | 4.933 | 0,00 | 1.013.476 | 0,31 |
| | 532.504.414 | 95,40 | 274.018.810 | 81,33 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | 5.197.440 | 0,93 | 3.460.687 | 1,02 |

Global High Yield Sustainable Action*

| | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: | | | | |
| Euro | – | – | 3.765.913 | 25,03 |
| Britisches Pfund | – | – | 792.792 | 5,27 |
| US-Dollar | – | – | 9.884.966 | 65,69 |
| | – | – | 14.443.671 | 95,99 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Global High Yield Sustainable Action* (Fortsetzung)

| | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene mittelfristige Schuldverschreibungen: | | | | |
| US-Dollar | – | – | 95.881 | 0,64 |
| | – | – | 14.539.552 | 96,63 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | – | – | (350.409) | (2,33) |

* Das Portfolio wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

Global Investment Grade Credit

| | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: | | | | |
| Kanadischer Dollar | 2.045.372 | 2,36 | 1.894.286 | 2,21 |
| Euro | 17.112.649 | 19,72 | 17.214.963 | 20,04 |
| Britisches Pfund | 6.421.929 | 7,40 | 4.004.142 | 4,66 |
| US-Dollar | 55.796.371 | 64,30 | 57.653.972 | 67,11 |
| | 81.376.321 | 93,78 | 80.767.363 | 94,02 |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen: | | | | |
| Euro | 758.536 | 0,87 | – | – |
| US-Dollar | 1.323.918 | 1,53 | 2.758.010 | 3,21 |
| | 2.082.454 | 2,40 | 2.758.010 | 3,21 |
| | 83.458.775 | 96,18 | 83.525.373 | 97,23 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | (1.106.335) | (1,28) | (1.626.695) | (1,90) |

Global Opportunistic Bond

| | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|---|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Agency Bonds: | | | | |
| US-Dollar | – | – | 307.820 | 0,40 |
| Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen): | | | | |
| Euro | 384.235 | 0,59 | 616.355 | 0,81 |
| Britisches Pfund | 67.935 | 0,10 | 91.718 | 0,12 |
| US-Dollar | 1.365.573 | 2,09 | 3.582.029 | 4,71 |
| | 1.817.743 | 2,78 | 4.290.102 | 5,64 |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: | | | | |
| Euro | 17.426.821 | 26,65 | 24.004.584 | 31,54 |
| Britisches Pfund | 4.452.439 | 6,80 | 3.799.491 | 4,99 |
| US-Dollar | 5.532.795 | 8,46 | 7.627.624 | 10,02 |
| | 27.412.055 | 41,91 | 35.431.699 | 46,55 |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen: | | | | |
| Australischer Dollar | 806.754 | 1,23 | – | – |
| Chinesischer Yuan Renminbi | 1.976.796 | 3,02 | 3.581.244 | 4,70 |
| Tschechische Krone | 514.023 | 0,79 | 413.371 | 0,54 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

| Global Opportunistic Bond (Fortsetzung) | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen (Fortsetzung): | | | | |
| Euro | 5.428.488 | 8,29 | 5.925.902 | 7,79 |
| Ungarischer Forint | 288.139 | 0,44 | – | – |
| Indonesische Rupiah | 1.613.604 | 2,47 | 324.042 | 0,42 |
| Japanischer Yen | – | – | 106.443 | 0,14 |
| Mexikanischer Peso | 2.891.430 | 4,42 | 1.444.773 | 1,90 |
| Neuseeländischer Dollar | 3.053.390 | 4,67 | 3.726.450 | 4,90 |
| Polnischer Zloty | 980.709 | 1,50 | 347.647 | 0,46 |
| Britisches Pfund | 413.338 | 0,63 | 465.305 | 0,61 |
| Südkoreanischer Won | 258.205 | 0,40 | – | – |
| Thailändischer Baht | 267.740 | 0,41 | 265.740 | 0,35 |
| US-Dollar | 2.640.767 | 4,04 | 8.110.126 | 10,66 |
| | 21.133.383 | 32,31 | 24.711.043 | 32,47 |
| Für den Handel gehaltene Mortgage-Backed Securities: | | | | |
| US-Dollar | 14.565.802 | 22,27 | 10.458.233 | 13,74 |
| Für den Handel gehaltene Investmentfonds: | | | | |
| Britisches Pfund | 21.165 | 0,03 | 107.216 | 0,14 |
| US-Dollar | – | – | 1.694.000 | 2,23 |
| | 21.165 | 0,03 | 1.801.216 | 2,37 |
| | 64.950.148 | 99,30 | 77.000.113 | 101,17 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | (2.049.562) | (3,14) | (2.418.728) | (3,18) |

| Global Real Estate Securities | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien: | | | | |
| Kanadischer Dollar | 117.134 | 0,57 | – | – |
| Euro | 157.095 | 0,77 | 967.525 | 2,48 |
| Hongkong-Dollar | 788.347 | 3,86 | 2.886.361 | 7,40 |
| Japanischer Yen | 729.085 | 3,56 | 1.896.887 | 4,86 |
| Britisches Pfund | 383.800 | 1,87 | – | – |
| Singapur-Dollar | 535.593 | 2,62 | 1.095.282 | 2,81 |
| Schweizer Franken | 304.936 | 1,49 | – | – |
| | 3.015.990 | 14,74 | 6.846.055 | 17,55 |
| Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften: | | | | |
| Australischer Dollar | 1.038.510 | 5,08 | 1.287.061 | 3,30 |
| Kanadischer Dollar | 710.266 | 3,47 | 1.814.574 | 4,65 |
| Euro | 1.332.446 | 6,51 | 964.954 | 2,47 |
| Hongkong-Dollar | 162.068 | 0,79 | 165.184 | 0,42 |
| Japanischer Yen | 1.009.965 | 4,94 | 1.709.702 | 4,38 |
| Britisches Pfund | 799.443 | 3,91 | 3.081.950 | 7,90 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

| Global Real Estate Securities (Fortsetzung) | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften (Fortsetzung): | | | | |
| Singapur-Dollar | 199.240 | 0,97 | 404.924 | 1,04 |
| US-Dollar | 11.819.730 | 57,77 | 20.932.449 | 53,64 |
| | 17.071.668 | 83,44 | 30.360.798 | 77,80 |
| | 20.087.658 | 98,18 | 37.206.853 | 95,35 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | 171.794 | 0,84 | 718.252 | 1,84 |

| Global Sustainable Equity | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|----------------------------------|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien: | | | | |
| Dänische Krone | 2.356.638 | 1,52 | 2.087.272 | 1,59 |
| Euro | 17.578.770 | 11,37 | 13.586.367 | 10,32 |
| Japanischer Yen | 2.808.506 | 1,82 | 1.579.691 | 1,20 |
| Norwegische Krone | 3.832.389 | 2,48 | 4.294.333 | 3,26 |
| Britisches Pfund | 4.527.650 | 2,93 | 4.178.560 | 3,18 |
| Schwedische Krone | 4.357.908 | 2,82 | 3.754.615 | 2,85 |
| Schweizer Franken | 12.094.419 | 7,82 | 5.969.089 | 4,54 |
| US-Dollar | 106.047.139 | 68,61 | 95.074.555 | 72,26 |
| | 153.603.419 | 99,37 | 130.524.482 | 99,20 |

| Global Sustainable Value | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|----------------------------------|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien: | | | | |
| Australischer Dollar | 1.631.790 | 2,94 | 1.063.750 | 2,21 |
| Brasilianischer Real | 566.280 | 1,02 | 260.528 | 0,54 |
| Kanadischer Dollar | 2.053.991 | 3,70 | 1.782.255 | 3,71 |
| Dänische Krone | – | – | 259.180 | 0,54 |
| Euro | 4.792.613 | 8,65 | 4.046.608 | 8,42 |
| Hongkong-Dollar | 1.646.031 | 2,97 | 1.631.434 | 3,40 |
| Indonesische Rupiah | 192.941 | 0,35 | 291.610 | 0,61 |
| Japanischer Yen | 3.141.436 | 5,66 | 2.696.878 | 5,62 |
| Mexikanischer Peso | 397.431 | 0,72 | 180.675 | 0,38 |
| Neuer taiwanesischer Dollar | 1.041.760 | 1,88 | 796.265 | 1,66 |
| Neuseeländischer Dollar | 110.969 | 0,20 | 63.031 | 0,13 |
| Norwegische Krone | 364.222 | 0,66 | 57.477 | 0,12 |
| Britisches Pfund | 2.659.501 | 4,80 | 2.087.872 | 4,35 |
| Singapur-Dollar | 245.963 | 0,44 | – | – |
| Südafrikanischer Rand | 199.332 | 0,36 | 370.092 | 0,77 |
| Südkoreanischer Won | 794.977 | 1,43 | 880.568 | 1,83 |
| Schwedische Krone | 133.986 | 0,24 | 383.756 | 0,80 |
| Schweizer Franken | 1.191.665 | 2,15 | 1.186.730 | 2,47 |
| US-Dollar | 32.644.183 | 58,84 | 28.921.680 | 60,23 |
| | 53.809.071 | 97,01 | 46.960.389 | 97,79 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

| Global Sustainable Value (Fortsetzung) | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften: | | | | |
| Australischer Dollar | 50.247 | 0,09 | 133.123 | 0,28 |
| Euro | 65.321 | 0,12 | 101.504 | 0,21 |
| Britisches Pfund | 21.788 | 0,04 | 108.028 | 0,22 |
| US-Dollar | 979.048 | 1,77 | 412.782 | 0,86 |
| | 1.116.404 | 2,02 | 755.437 | 1,57 |
| | 54.925.475 | 99,03 | 47.715.826 | 99,36 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | 19.551 | 0,04 | 34.856 | 0,07 |

| High Yield Bond | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|---|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen): | | | | |
| US-Dollar | 10.897.982 | 0,49 | 21.830.306 | 0,95 |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: | | | | |
| Euro | – | – | 3.839.814 | 0,16 |
| US-Dollar | 1.999.177.351 | 88,78 | 1.978.713.612 | 86,08 |
| | 1.999.177.351 | 88,78 | 1.982.553.426 | 86,24 |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen: | | | | |
| US-Dollar | 36.225.768 | 1,61 | – | – |
| Für den Handel gehaltene mittelfristige Schuldverschreibungen: | | | | |
| US-Dollar | 43.084.058 | 1,91 | 91.635.501 | 3,99 |
| Für den Handel gehaltene Investmentfonds: | | | | |
| Britisches Pfund | 3.611.285 | 0,16 | 18.294.706 | 0,80 |
| | 2.092.996.444 | 92,95 | 2.114.313.939 | 91,98 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | 25.265.889 | 1,12 | 30.109.875 | 1,31 |

| InnovAsia 5G | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|----------------------------------|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien: | | | | |
| Australischer Dollar | 173.907 | 0,73 | – | – |
| Chinesischer Yuan Renminbi | 1.007.839 | 4,24 | 2.183.240 | 14,80 |
| Hongkong-Dollar | – | – | 212.641 | 1,44 |
| Indische Rupie | 2.729.942 | 11,49 | 539.135 | 3,66 |
| Japanischer Yen | 6.224.873 | 26,19 | 3.928.339 | 26,64 |
| Malaysischer Ringgit | 481.076 | 2,02 | 319.895 | 2,17 |
| Neuer taiwanesischer Dollar | 5.480.052 | 23,05 | 3.802.814 | 25,78 |
| Singapur-Dollar | 563.158 | 2,37 | 505.401 | 3,43 |
| Südkoreanischer Won | 3.391.560 | 14,27 | 515.684 | 3,50 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

| InnovAsia 5G (Fortsetzung) | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien (Fortsetzung): | | | | |
| Thailändischer Baht | 715.164 | 3,01 | – | – |
| US-Dollar | 1.208.522 | 5,08 | 1.472.362 | 9,98 |
| Vietnamesischer Dong | 548.794 | 2,31 | 392.997 | 2,66 |
| | 22.524.887 | 94,76 | 13.872.508 | 94,06 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | 238.999 | 1,01 | 374.607 | 2,54 |

| Japan Equity Engagement | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|---|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert JPY | % des Netto- vermögens | Marktwert JPY | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien: | | | | |
| Japanischer Yen | 15.961.893.000 | 98,67 | 20.207.455.300 | 98,37 |
| | 15.961.893.000 | 98,67 | 20.207.455.300 | 98,37 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | 86.481.827 | 0,53 | (96.683.905) | (0,47) |

| Macro Opportunities FX | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert EUR | % des Netto- vermögens | Marktwert EUR | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Schatzwechsel: | | | | |
| Euro | 2.407.376 | 83,54 | 4.389.983 | 13,93 |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: | | | | |
| Euro | – | – | 24.967.521 | 79,24 |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen: | | | | |
| Euro | 347.166 | 12,04 | 2.778.639 | 8,82 |
| | 2.754.542 | 95,58 | 32.136.143 | 101,99 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | 13.600 | 0,48 | (811.369) | (2,58) |

| Multi-Asset Income* | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Agency Bonds: | | | | |
| US-Dollar | – | – | 7.644 | 0,07 |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: | | | | |
| Euro | – | – | 2.941.980 | 25,88 |
| Britisches Pfund | – | – | 213.717 | 1,88 |
| US-Dollar | – | – | 1.725.211 | 15,18 |
| | – | – | 4.880.908 | 42,94 |
| Für den Handel gehaltene Aktien: | | | | |
| Australischer Dollar | – | – | 43.240 | 0,38 |
| Brasilianischer Real | – | – | 17.407 | 0,15 |
| Euro | – | – | 151.800 | 1,34 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

| Multi-Asset Income* (Fortsetzung) | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien (Fortsetzung): | | | | |
| Hongkong-Dollar | – | – | 98.904 | 0,87 |
| Japanischer Yen | – | – | 108.100 | 0,95 |
| Neuer taiwanesischer Dollar | – | – | 23.212 | 0,20 |
| Britisches Pfund | – | – | 73.519 | 0,65 |
| Südafrikanischer Rand | – | – | 8.339 | 0,07 |
| Südkoreanischer Won | – | – | 30.543 | 0,27 |
| Schweizer Franken | – | – | 46.212 | 0,41 |
| US-Dollar | – | – | 2.247.172 | 19,77 |
| | – | – | 2.848.448 | 25,06 |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen: | | | | |
| US-Dollar | – | – | 311.601 | 2,74 |
| Für den Handel gehaltene Investmentfonds: | | | | |
| Britisches Pfund | – | – | 8.560 | 0,08 |
| US-Dollar | – | – | 593.625 | 5,22 |
| | – | – | 602.185 | 5,30 |
| Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften: | | | | |
| Südafrikanischer Rand | – | – | 2.166 | 0,02 |
| US-Dollar | – | – | 362.642 | 3,19 |
| | – | – | 364.808 | 3,21 |
| | – | – | 9.015.594 | 79,32 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | – | – | (431.372) | (3,80) |

* Das Portfolio wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

| Next Generation Mobility | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien: | | | | |
| Kanadischer Dollar | 923.624 | 0,56 | 2.312.662 | 1,56 |
| Chinesischer Yuan Renminbi | 821.040 | 0,50 | 1.537.306 | 1,04 |
| Euro | 8.462.265 | 5,15 | 5.688.591 | 3,84 |
| Hongkong-Dollar | 3.671.609 | 2,23 | 3.880.762 | 2,62 |
| Japanischer Yen | 3.261.498 | 1,98 | 2.867.915 | 1,94 |
| Neuer taiwanesischer Dollar | 1.653.606 | 1,01 | 1.016.740 | 0,69 |
| Südkoreanischer Won | 1.389.795 | 0,85 | – | – |
| Schwedische Krone | 2.040.128 | 1,24 | 1.854.267 | 1,25 |
| US-Dollar | 128.971.071 | 78,47 | 117.719.542 | 79,54 |
| | 151.194.636 | 91,99 | 136.877.785 | 92,48 |
| Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften: | | | | |
| US-Dollar | 1.619.728 | 0,99 | 1.522.531 | 1,03 |
| | 152.814.364 | 92,98 | 138.400.316 | 93,51 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | 10.424 | 0,00 | 80.667 | 0,06 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Next Generation Space Economy²

| | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|----------------------------------|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien: | | | | |
| Chinesischer Yuan Renminbi | 291.964 | 1,48 | 103.745 | 1,22 |
| Euro | 2.149.013 | 10,88 | 1.179.050 | 13,89 |
| Japanischer Yen | 1.343.794 | 6,81 | 172.026 | 2,03 |
| Neuer taiwanesischer Dollar | 190.613 | 0,96 | 134.551 | 1,58 |
| Britisches Pfund | 714.841 | 3,62 | 357.829 | 4,21 |
| Singapur-Dollar | 591.271 | 2,99 | 270.258 | 3,18 |
| Südkoreanischer Won | 1.016.293 | 5,15 | 288.684 | 3,40 |
| US-Dollar | 12.376.927 | 62,69 | 5.475.531 | 64,49 |
| | 18.674.716 | 94,58 | 7.981.674 | 94,00 |

²Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

Responsible Asian Debt - Hard Currency

| | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Schatzwechsel: | | | | |
| US-Dollar | 2.496.736 | 3,90 | – | – |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: | | | | |
| US-Dollar | 45.692.223 | 71,46 | 18.090.069 | 83,65 |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen: | | | | |
| Euro | 2.185.563 | 3,42 | 633.146 | 2,93 |
| US-Dollar | 9.839.633 | 15,39 | 1.457.840 | 6,74 |
| | 12.025.196 | 18,81 | 2.090.986 | 9,67 |
| | 60.214.155 | 94,17 | 20.181.055 | 93,32 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | 120.024 | 0,19 | (6.712) | (0,03) |

Short Duration Emerging Market Debt

| | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Schatzwechsel: | | | | |
| US-Dollar | 53.894.704 | 1,36 | 51.075.667 | 1,00 |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: | | | | |
| Euro | 10.195.525 | 0,26 | 41.269.865 | 0,81 |
| US-Dollar | 2.396.291.848 | 60,59 | 3.486.415.742 | 68,03 |
| | 2.406.487.373 | 60,85 | 3.527.685.607 | 68,84 |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen: | | | | |
| Euro | 362.400.411 | 9,17 | 225.469.117 | 4,40 |
| US-Dollar | 945.231.530 | 23,90 | 980.358.585 | 19,13 |
| | 1.307.631.941 | 33,07 | 1.205.827.702 | 23,53 |
| Für den Handel gehaltene Investmentfonds: | | | | |
| US-Dollar | 49.810.000 | 1,26 | 70.347.000 | 1,37 |
| | 3.817.824.018 | 96,54 | 4.854.935.976 | 94,74 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | – | – | (1.843.240) | (0,04) |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | 55.420.371 | 1,40 | 22.713.291 | 0,44 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

| Short Duration High Yield SDG Engagement | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|---|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Schatzwechsel: | | | | |
| US-Dollar | – | – | 10.810.063 | 1,94 |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: | | | | |
| US-Dollar | 664.013.737 | 89,20 | 477.638.711 | 85,85 |
| Für den Handel gehaltene mittelfristige Schuldverschreibungen: | | | | |
| US-Dollar | 13.420.047 | 1,80 | 23.578.927 | 4,24 |
| Für den Handel gehaltene Investmentfonds: | | | | |
| Britisches Pfund | 241.028 | 0,03 | 1.221.039 | 0,22 |
| | 677.674.812 | 91,03 | 513.248.740 | 92,25 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | 12.140.835 | 1,63 | 17.725.693 | 3,18 |
| Strategic Income | | | | |
| | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien: | | | | |
| US-Dollar | 22.512 | 0,00 | – | – |
| Für den Handel gehaltene Schatzwechsel: | | | | |
| US-Dollar | 221.166.130 | 10,95 | 8.017.122 | 0,61 |
| Für den Handel gehaltene Agency Bonds: | | | | |
| US-Dollar | 781.434 | 0,04 | 772.053 | 0,06 |
| Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen): | | | | |
| US-Dollar | 211.031.917 | 10,45 | 105.467.359 | 7,97 |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: | | | | |
| Euro | 82.785.192 | 4,10 | 30.404.992 | 2,30 |
| Britisches Pfund | 20.389.514 | 1,01 | 5.246.297 | 0,40 |
| US-Dollar | 432.669.604 | 21,42 | 601.915.888 | 45,50 |
| | 535.844.310 | 26,53 | 637.567.177 | 48,20 |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen: | | | | |
| Kolumbianischer Peso | 2.200.755 | 0,11 | 1.405.082 | 0,11 |
| Ungarischer Forint | 2.620.824 | 0,13 | 1.753.111 | 0,13 |
| Indonesische Rupiah | 3.750.751 | 0,19 | 3.588.355 | 0,27 |
| Mexikanischer Peso | 6.951.252 | 0,34 | 2.721.504 | 0,21 |
| Peruanischer Sol | 4.098.321 | 0,20 | 4.407.353 | 0,33 |
| Polnischer Zloty | 2.823.563 | 0,14 | – | – |
| Rumänischer neuer Leu | 4.056.767 | 0,20 | – | – |
| Südafrikanischer Rand | 2.180.039 | 0,11 | 1.824.633 | 0,14 |
| Türkische Lira | – | – | 1.705.418 | 0,13 |
| US-Dollar | 146.987.608 | 7,28 | 225.951.909 | 17,08 |
| | 175.669.880 | 8,70 | 243.357.365 | 18,40 |
| Für den Handel gehaltene Mortgage-Backed Securities: | | | | |
| US-Dollar | 918.338.562 | 45,47 | 346.893.475 | 26,22 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

| Strategic Income (Fortsetzung) | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|--|---------------------------|-----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Kommunalanleihen: | | | | |
| US-Dollar | 12.918.823 | 0,64 | 20.744.098 | 1,57 |
| Für den Handel gehaltene mittelfristige Schuldverschreibungen: | | | | |
| US-Dollar | 429.819 | 0,02 | 579.804 | 0,04 |
| Für den Handel gehaltene Investmentfonds: | | | | |
| Britisches Pfund | 145.814 | 0,01 | 738.685 | 0,05 |
| US-Dollar | 60.620.640 | 3,00 | 57.487.152 | 4,35 |
| | 60.766.454 | 3,01 | 58.225.837 | 4,40 |
| | 2.136.969.841 | 105,81 | 1.421.624.290 | 107,47 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | 930.018 | 0,04 | 19.437.605 | 1,47 |
| Sustainable Asia High Yield | | | | |
| | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: | | | | |
| US-Dollar | 24.364.117 | 85,29 | 27.495.016 | 86,13 |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen: | | | | |
| US-Dollar | 2.505.094 | 8,77 | 837.924 | 2,63 |
| | 26.869.211 | 94,06 | 28.332.940 | 88,76 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | (17.944) | (0,06) | 266.230 | 0,83 |
| Sustainable Emerging Market Corporate Debt | | | | |
| | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: | | | | |
| US-Dollar | 83.464.415 | 85,35 | 86.982.672 | 88,54 |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen: | | | | |
| Euro | 3.224.557 | 3,30 | 2.325.515 | 2,37 |
| US-Dollar | 3.943.827 | 4,03 | 2.075.893 | 2,11 |
| | 7.168.384 | 7,33 | 4.401.408 | 4,48 |
| | 90.632.799 | 92,68 | 91.384.080 | 93,02 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | 1.461.588 | 1,50 | 761.197 | 0,77 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

| Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency ² | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|---|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: | | | | |
| US-Dollar | 28.120.429 | 6,31 | 7.708.197 | 4,87 |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen: | | | | |
| Euro | 157.346.786 | 35,29 | 40.133.656 | 25,33 |
| US-Dollar | 230.334.993 | 51,65 | 95.972.503 | 60,58 |
| | 387.681.779 | 86,94 | 136.106.159 | 85,91 |
| | 415.802.208 | 93,25 | 143.814.356 | 90,78 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | 10.665.593 | 2,39 | 2.895.404 | 1,83 |

| Tactical Macro ¹ | 31. Dezember 2023 | |
|---|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Schatzwechsel: | | |
| US-Dollar | 22.994.103 | 84,66 |
| | 22.994.103 | 84,66 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | 173.202 | 0,63 |

¹ Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

² Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

| Ultra Short Term Euro Bond | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|---|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert EUR | % des Netto- vermögens | Marktwert EUR | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Schatzwechsel: | | | | |
| Euro | 8.960.964 | 0,90 | – | – |
| Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen): | | | | |
| Euro | 90.687.160 | 9,14 | 72.343.961 | 8,81 |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: | | | | |
| Euro | 789.167.617 | 79,48 | 670.503.994 | 81,63 |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen: | | | | |
| Euro | 75.386.047 | 7,59 | 56.450.113 | 6,87 |
| | 964.201.788 | 97,11 | 799.298.068 | 97,31 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | (6.740.350) | (0,68) | (925.722) | (0,12) |

| Uncorrelated Strategies | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|--|-------------------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | Marktwert US\$ | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien: | | | | |
| Euro | 1.692.087 | 0,10 | 1.951.285 | 0,07 |
| Japanischer Yen | – | – | 694.532 | 0,02 |
| Schweizer Franken | 31.648 | 0,00 | – | – |
| US-Dollar | 75.568.717 | 4,65 | 132.722.211 | 4,23 |
| | 77.292.452 | 4,75 | 135.368.028 | 4,32 |
| Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften: | | | | |
| US-Dollar | 1.217.656 | 0,07 | 4.976.282 | 0,16 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

| | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|--|-------------------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | Marktwert US\$ | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Participatory Notes: | | | | |
| Euro | 2.209 | 0,00 | 6.404 | 0,00 |
| Britisches Pfund | 14.342 | 0,00 | 15.036 | 0,00 |
| US-Dollar | 20.494 | 0,00 | – | – |
| | 37.045 | 0,00 | 21.440 | 0,00 |
| Für den Handel gehaltene Schatzwechsel: | | | | |
| US-Dollar | 707.195.701 | 43,48 | 1.582.793.462 | 50,57 |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: | | | | |
| Euro | 668.976 | 0,04 | 26.126.967 | 0,84 |
| Japanischer Yen | 1.549.865 | 0,09 | – | – |
| Britisches Pfund | – | – | 3.685.493 | 0,12 |
| US-Dollar | 118.399.986 | 7,28 | 131.574.600 | 4,20 |
| | 120.618.827 | 7,41 | 161.387.060 | 5,16 |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen: | | | | |
| Polnischer Zloty | 2.810.381 | 0,17 | – | – |
| Südafrikanischer Rand | 13.608.831 | 0,84 | – | – |
| US-Dollar | 22.545.359 | 1,39 | 4.218.750 | 0,13 |
| | 38.964.571 | 2,40 | 4.218.750 | 0,13 |
| | 945.326.252 | 58,11 | 1.888.765.022 | 60,34 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | 30.977.706 | 1,91 | 177.192.829 | 5,66 |

Uncorrelated Trading^{2*}

| | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien: | | | | |
| US-Dollar | – | – | 16.089.324 | 2,26 |
| Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften: | | | | |
| US-Dollar | – | – | 3.946.436 | 0,55 |
| Für den Handel gehaltene Schatzwechsel: | | | | |
| US-Dollar | – | – | 449.200.010 | 63,10 |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: | | | | |
| Euro | – | – | 5.556.545 | 0,78 |
| Britisches Pfund | – | – | 921.374 | 0,13 |
| US-Dollar | – | – | 6.743.516 | 0,95 |
| | – | – | 13.221.435 | 1,86 |
| | – | – | 482.457.205 | 67,77 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | – | – | 56.910.001 | 7,99 |

² Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

* Das Portfolio wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

| US Equity | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien: | | | | |
| US-Dollar | 45.872.647 | 93,23 | 27.005.260 | 85,83 |
| Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften: | | | | |
| US-Dollar | – | – | 478.769 | 1,52 |
| | 45.872.647 | 93,23 | 27.484.029 | 87,35 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | 1.134.529 | 2,31 | 1.611.149 | 5,12 |
| US Equity Index PutWrite | | | | |
| | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen: | | | | |
| US-Dollar | 663.357.136 | 90,98 | 632.264.076 | 92,92 |
| | 663.357.136 | 90,98 | 632.264.076 | 92,92 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | 6.338.906 | 0,88 | 2.309.131 | 0,34 |
| US Large Cap Value | | | | |
| | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien: | | | | |
| US-Dollar | 1.847.675.317 | 95,28 | 1.688.625.847 | 95,51 |
| Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften: | | | | |
| US-Dollar | 3.901.309 | 0,20 | – | – |
| | 1.851.576.626 | 95,48 | 1.688.625.847 | 95,51 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | 1.003.185 | 0,05 | 871.125 | 0,05 |
| US Long Short Equity | | | | |
| | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien: | | | | |
| Euro | 1.648.923 | 0,84 | 1.265.964 | 0,57 |
| US-Dollar | 164.934.480 | 84,38 | 156.744.366 | 70,76 |
| | 166.583.403 | 85,22 | 158.010.330 | 71,33 |
| Für den Handel gehaltene Participatory Notes: | | | | |
| US-Dollar | – | – | 3.750 | 0,00 |
| Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften: | | | | |
| US-Dollar | 3.534.047 | 1,81 | 1.744.930 | 0,79 |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: | | | | |
| US-Dollar | 7.670.535 | 3,92 | 8.400.448 | 3,79 |
| Für den Handel gehaltene mittelfristige Schuldverschreibungen: | | | | |
| US-Dollar | 487.831 | 0,25 | – | – |
| | 178.275.816 | 91,20 | 168.159.458 | 75,91 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | (4.829.968) | (2,47) | 8.094.369 | 3,66 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

| US Multi Cap Opportunities | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien: | | | | |
| US-Dollar | 396.982.739 | 99,12 | 439.025.865 | 99,48 |
| | 396.982.739 | 99,12 | 439.025.865 | 99,48 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | 1.518.722 | 0,38 | 2.148.740 | 0,49 |
| US Real Estate Securities | | | | |
| | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften: | | | | |
| US-Dollar | 519.992.632 | 97,54 | 624.531.489 | 96,38 |
| | 519.992.632 | 97,54 | 624.531.489 | 96,38 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | 1.917.164 | 0,36 | 2.859.608 | 0,44 |
| US Small Cap | | | | |
| | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien: | | | | |
| US-Dollar | 622.291.910 | 98,17 | 578.779.674 | 97,70 |
| | 622.291.910 | 98,17 | 578.779.674 | 97,70 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | 610.226 | 0,10 | 712.758 | 0,12 |
| US Small Cap Intrinsic Value | | | | |
| | 31. Dezember 2023 | | 31. Dezember 2022 | |
| | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens | Marktwert US\$ | % des Netto- vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien: | | | | |
| US-Dollar | 299.826.372 | 93,24 | 184.718.734 | 95,19 |
| Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften: | | | | |
| US-Dollar | 1.910.421 | 0,59 | 2.170.638 | 1,12 |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: | | | | |
| US-Dollar | 0 | 0,00 | – | – |
| | 301.736.793 | 93,83 | 186.889.372 | 96,31 |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | (398) | (0,00) | – | – |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko

Der Nettoinventarwert je Anteil eines Portfolios wird in der Basiswährung des betreffenden Portfolios berechnet. Anlagen, die für Rechnung des Portfolios gehalten werden, können jedoch in anderen Währungen erworben werden. Der Wert der Basiswährung der Anlagen eines auf eine andere Währung lautenden Portfolios kann aufgrund von Währungsschwankungen in Bezug auf die jeweiligen Währungen steigen oder fallen. Nachteilige Veränderungen der Wechselkurse können zu einer Verringerung der Rendite und einem Kapitalverlust führen. Die Positionen werden täglich überwacht, und es werden Absicherungsstrategien zur Sicherstellung eingesetzt, dass die Positionen innerhalb festgelegter Limits bleiben.

Zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 hätten bei einem Anstieg der Basiswährung des betreffenden Portfolios gegenüber allen Währungen um 5 % und bei gleichzeitiger Konstanz aller anderen Variablen das Nettovermögen und die Veränderung des Nettovermögens gemäß Gewinn- und Verlustrechnung wie in der nachstehenden Tabelle aufgeführt (abgenommen)/zugenommen.

| Portfolio | Währung | 31. Dezember 2023 | % des Nettovermögens | 31. Dezember 2022 | % des Nettovermögens |
|---|---------|-------------------|----------------------|-------------------|----------------------|
| 5G Connectivity | USD | 15.448.010 | 1,48 % | 16.196.327 | 1,63 % |
| China A-Share Equity | CNY | 664.105 | 4,67 % | 766.150 | 4,72 % |
| China Bond | CNY | 14.705.878 | 3,20 % | 5.708.838 | 1,26 % |
| China Equity | USD | 7.902.362 | 4,43 % | 15.222.965 | 4,80 % |
| Climate Innovation ² | USD | 51.253 | 1,75 % | - | - |
| CLO Income | USD | 2.552.853 | 1,38 % | 611.238 | 0,44 % |
| Commodities ¹ | USD | 90.805 | 0,06 % | 59.977 | 0,07 % |
| Corporate Hybrid Bond | EUR | 37.063.252 | 1,98 % | 35.490.162 | 1,99 % |
| Developed Market FMP – 2027 ² | USD | 1.974 | 0,00 % | - | - |
| Emerging Market Debt – Hard Currency | USD | 27.540.375 | 1,04 % | 22.052.213 | 0,89 % |
| Emerging Market Debt – Local Currency | USD | 57.903.637 | 4,50 % | 63.850.053 | 4,61 % |
| Emerging Market Debt Blend | USD | 13.736.311 | 2,61 % | 12.004.568 | 2,55 % |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | USD | 1.867.386 | 2,87 % | 1.470.659 | 2,71 % |
| Emerging Markets Equity | USD | 3.657.753 | 4,03 % | 8.346.156 | 4,35 % |
| Emerging Markets Select Equity* | USD | 201 | 0,00 % | 3.972.405 | 4,24 % |
| Euro Bond | EUR | (471) | 0,00 % | (572) | (0,01 %) |
| Euro Bond Absolute Return | EUR | 74.833 | 0,22 % | 685.901 | 1,41 % |
| European High Yield Bond | EUR | 2.923.587 | 0,72 % | 151.849 | 0,47 % |
| European Sustainable Equity | EUR | 4.362.047 | 2,53 % | 4.591.665 | 2,61 % |
| Event Driven ¹ | USD | 209.067 | 0,17 % | 45.069 | 0,11 % |
| Global Bond | USD | 2.550.381 | 2,35 % | 2.992.478 | 2,22 % |
| Global Diversified Income FMP – 2024 | USD | 14.086 | 0,01 % | 26.179 | 0,02 % |
| Global Equity Megatrends | USD | 670.810 | 0,46 % | 470.294 | 0,59 % |
| Global Flexible Credit Income | USD | 3.927.885 | 1,01 % | 4.319.726 | 1,09 % |
| Global High Yield SDG Engagement | USD | 5.963.760 | 1,07 % | 2.865.536 | 0,85 % |
| Global High Yield Sustainable Action* | USD | 36 | 0,00 % | 211.087 | 1,40 % |
| Global Investment Grade Credit | USD | 1.327.438 | 1,53 % | 1.170.010 | 1,36 % |
| Global Opportunistic Bond | USD | 2.039.335 | 3,12 % | 2.273.392 | 2,99 % |
| Global Real Estate Securities | USD | 422.417 | 2,06 % | 850.597 | 2,18 % |
| Global Sustainable Equity | USD | 2.410.032 | 1,56 % | 1.772.787 | 1,35 % |
| Global Sustainable Value | USD | 1.066.592 | 1,92 % | 921.286 | 1,92 % |
| High Yield Bond | USD | 1.650.638 | 0,07 % | 3.112.894 | 0,14 % |
| InnovAsia 5G | USD | 1.076.997 | 4,53 % | 638.402 | 4,33 % |
| Japan Equity Engagement | JPY | 4.663.754 | 0,03 % | (8.146.918) | (0,04 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

| Portfolio | Währung | 31. Dezember 2023 | % des Nettovermögens | 31. Dezember 2022 | % des Nettovermögens |
|---|---------|-------------------|----------------------|-------------------|----------------------|
| Macro Opportunities FX | EUR | 2.121 | 0,07 % | (39.764) | (0,13 %) |
| Multi-Asset Income* | USD | - | 0,00 % | 182.057 | 1,60 % |
| Next Generation Mobility | USD | 1.100.784 | 0,67 % | 971.244 | 0,66 % |
| Next Generation Space Economy ¹ | USD | 323.291 | 1,64 % | 125.136 | 1,47 % |
| Responsible Asian Debt – Hard Currency | USD | 118.753 | 0,19 % | 32.863 | 0,15 % |
| Short Duration Emerging Market Debt | USD | 22.091.968 | 0,56 % | 16.156.419 | 0,32 % |
| Short Duration High Yield SDG Engagement | USD | 761.620 | 0,10 % | 1.001.077 | 0,18 % |
| Strategic Income | USD | 9.712.500 | 0,48 % | 3.809.057 | 0,29 % |
| Sustainable Asia High Yield | USD | 932 | 0,00 % | 12.741 | 0,04 % |
| Sustainable Emerging Market Corporate Debt | USD | 247.125 | 0,25 % | 38.780 | 0,04 % |
| Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency ¹ | USD | 8.390.584 | 1,88 % | 2.325.609 | 1,47 % |
| Tactical Macro ² | USD | (3.431) | (0,01 %) | - | - |
| Ultra Short Term Euro Bond | EUR | (108.980) | (0,01 %) | (314.975) | (0,04 %) |
| Uncorrelated Strategies | USD | 5.921.898 | 0,36 % | 7.030.682 | 0,22 % |
| Uncorrelated Trading ^{1*} | USD | (11) | 0,00 % | 3.480.578 | 0,49 % |
| US Equity | USD | 56.878 | 0,12 % | 80.558 | 0,26 % |
| US Equity Index PutWrite | USD | 571.074 | 0,08 % | 785.232 | 0,12 % |
| US Large Cap Value | USD | 72.229 | 0,00 % | 79.926 | 0,00 % |
| US Long Short Equity | USD | 210.821 | 0,11 % | 338.890 | 0,15 % |
| US Multi Cap Opportunities | USD | 57.658 | 0,01 % | 106.892 | 0,02 % |
| US Real Estate Securities | USD | 96.763 | 0,02 % | 137.254 | 0,02 % |
| US Small Cap | USD | 36.361 | 0,01 % | 39.073 | 0,01 % |
| US Small Cap Intrinsic Value | USD | 13.463 | 0,00 % | 10.357 | 0,01 % |

¹ Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

² Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

* Der Teilfonds wurde während des aktuellen oder vorherigen Berichtsjahres aufgelöst.

Eine Abschwächung der Basiswährung des betreffenden Portfolios gegenüber den oben genannten Währungen um 5 % hätte bei Konstanz aller anderen Variablen auf die oben aufgeführten Beträge im Jahresabschluss den entgegengesetzten Effekt in gleicher Höhe gehabt. Das Währungsrisiko wurde auf Basis des Nettovermögens des Portfolios berechnet, das auf eine andere Währung als die Basiswährung des betreffenden Portfolios lautet. Der Manager hält 5 % für einen angemessenen Satz für Wechselkurseffekte.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

In den nachstehenden Tabellen sind die Preisrisiken der betreffenden Portfolios insgesamt zusammengefasst.

| | 5G Connectivity | | China A-Share Equity | | China Bond | |
|---------------------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | CNY | CNY | CNY | CNY |
| Australischer Dollar | 769.833 | 479.859 | - | - | - | - |
| Chinesischer Yuan Renminbi | - | - | 931.733 | 918.751 | 164.728.545 | 338.866.827 |
| Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore | 2.368.424 | 88.434.633 | 11.487.246 | 14.345.263 | 175.328.923 | - |
| Euro | 84.962.476 | 68.866.568 | - | - | 898 | 1.833 |
| Hongkong-Dollar | (7.935) | 16.645.530 | 1.794.336 | 977.264 | - | - |
| Japanischer Yen | 103.938.608 | 92.855.666 | - | - | - | - |
| Neuer taiwanesischer Dollar | 88.565.742 | 46.686.340 | - | - | - | - |
| Britisches Pfund | 380.189 | 769.130 | - | - | 1.322 | (3.579) |
| Singapur-Dollar | 875.928 | 1.578.903 | - | - | (8.833) | 194 |
| Südafrikanischer Rand | 80.837 | - | - | - | - | - |
| Südkoreanischer Won | 27.019.657 | 7.609.911 | - | - | - | - |
| Schweizer Franken | 6.442 | - | - | - | - | - |
| US-Dollar | 734.566.742 | 669.083.653 | 517 | 480 | 118.795.253 | 114.178.304 |
| | 1.043.526.943 | 993.010.193 | 14.213.832 | 16.241.758 | 458.846.108 | 453.043.579 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

| | China Equity | | Climate Innovation ¹ | | CLO Income | |
|---------------------------------------|-----------------------|-----------------------|---------------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Chinesischer Yuan Renminbi | 2.855.957 | 3.234.457 | - | - | - | - |
| Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore | 74.424.349 | 128.939.869 | 22.928 | - | - | - |
| Euro | (3.795) | 180.591 | 423.573 | - | 50.844.680 | 10.342.101 |
| Hongkong-Dollar | 80.726.155 | 172.004.521 | 106.864 | - | - | - |
| Japanischer Yen | - | - | 86.565 | - | - | - |
| Norwegische Krone | - | - | 7.036 | - | - | - |
| Britisches Pfund | 499 | 870 | 91.036 | - | 2.908 | 1.747.984 |
| Singapur-Dollar | 31.240 | 81.549 | - | - | - | - |
| Südkoreanischer Won | - | - | 227.583 | - | - | - |
| Schwedische Krone | - | - | - | - | 209.466 | 134.665 |
| Schweizer Franken | 12.827 | 17.439 | 59.474 | - | - | - |
| US-Dollar | 20.179.055 | 12.954.380 | 1.897.496 | - | 134.589.251 | 125.812.714 |
| | 178.226.287 | 317.413.676 | 2.922.555 | - | 185.646.305 | 138.037.464 |

| | Commodities ² | | Corporate Hybrid Bond | | Developed Market FMP – 2027 ¹ | |
|----------------------|--------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|--|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | EUR | EUR | US\$ | US\$ |
| Australischer Dollar | - | - | 71.869 | (84.871) | - | - |
| Euro | - | - | 1.128.551.430 | 1.072.351.561 | 39.476 | - |
| Britisches Pfund | 1.816.095 | 1.199.530 | 469.298.379 | 383.674.609 | - | - |
| Singapur-Dollar | - | - | (11.417) | (11.783) | - | - |
| Schweizer Franken | - | - | 160.617 | (429.363) | - | - |
| US-Dollar | 151.830.464 | 84.797.899 | 271.745.585 | 326.654.655 | 137.418.343 | - |
| | 153.646.559 | 85.997.429 | 1.869.816.463 | 1.782.154.808 | 137.457.819 | - |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

| | Emerging Market Debt - Hard Currency | | Emerging Market Debt - Local Currency | | Emerging Market Debt Blend | |
|---------------------------------------|--------------------------------------|-----------------------|---------------------------------------|-----------------------|----------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Argentinischer Peso | - | - | 2.890 | 8.677 | 993 | 2.982 |
| Australischer Dollar | 601.670 | 172.417 | 711.720 | 253.560 | 94.706 | 46.451 |
| Brasilianischer Real | - | - | 291.529 | (18.304.450) | (1.704.435) | (3.013.341) |
| Kanadischer Dollar | - | - | 842 | 790 | 279 | 262 |
| Chilenischer Peso | - | - | 26.641.503 | 20.114.549 | 3.159.484 | 1.065.106 |
| Chinesischer Yuan Renminbi | - | - | 94.077.109 | 134.202.029 | 18.981.129 | 15.810.305 |
| Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore | - | - | (382.644) | 45.826 | (114.012) | 18.949 |
| Kolumbianischer Peso | - | - | 114.707.095 | 86.990.761 | 26.663.057 | 16.810.382 |
| Tschechische Krone | - | - | 62.128.688 | 72.788.675 | 15.760.898 | 11.496.050 |
| Peso Dominikanische Republik | - | - | 6.712.333 | 2.610.187 | 1.455.729 | 624.770 |
| Ägyptisches Pfund | - | - | (528.913) | 466.870 | (68.180) | 82.365 |
| Euro | 539.044.170 | 453.159.994 | 700.146 | (1.258.427) | 21.297.201 | 24.578.138 |
| Ghanaischer Cedi | - | - | 1.740.612 | 4.492.772 | 357.726 | 936.601 |
| Hongkong-Dollar | 6.588 | 1.272 | - | - | - | - |
| Ungarischer Forint | - | - | 35.592.912 | (3.848.897) | 7.558.875 | (1.926.397) |
| Indische Rupie | - | - | 25.342 | - | 7.083 | - |
| Indonesische Rupiah | - | - | 134.135.500 | 137.041.955 | 29.227.651 | 22.589.671 |
| Israelischer Schekel | - | - | (1.992.838) | (843.671) | (424.993) | (136.238) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

| | Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung) | | Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung) | | Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung) | |
|-----------------------------|--|-----------------------|---|-----------------------|--|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Japanischer Yen | 455.988 | 360.169 | 24.384 | 32.421 | - | - |
| Malaysischer Ringgit | - | - | 117.522.624 | 139.683.449 | 24.310.403 | 22.805.460 |
| Mexikanischer Peso | - | - | 106.797.062 | 142.845.938 | 23.835.040 | 23.413.075 |
| Neuer taiwanesischer Dollar | - | - | (11.844) | (278.813) | (1.736) | (48.237) |
| Nigerianischer Naira | - | - | 4.665 | 9.088 | 1.460 | 2.843 |
| Norwegische Krone | - | - | - | - | 912 | 150 |
| Peruanischer Sol | - | - | 38.164.906 | 33.432.856 | 9.927.219 | 7.753.772 |
| Philippinischer Peso | - | - | 5.069.836 | 40.447 | 1.121.450 | 6.772 |
| Polnischer Zloty | - | - | 122.435.640 | 125.311.661 | 27.577.765 | 32.614.821 |
| Britisches Pfund | 1.369.267 | (1.179.852) | 5.145 | (478.553) | 102.739 | (167.874) |
| Rumänischer Leu | - | - | 40.339.921 | 56.063.139 | 8.369.423 | 8.884.562 |
| Serbischer Dinar | - | - | 3.648.955 | 4.872.169 | 790.524 | 873.537 |
| Singapur-Dollar | 735.239 | 149.452 | (13.987) | 300.469 | 21.891 | 197.329 |
| Südafrikanischer Rand | - | - | 128.414.178 | 183.733.684 | 27.255.355 | 28.878.918 |
| Südkoreanischer Won | - | - | 2.474.058 | (219.330) | 563.511 | 47.856 |
| Schwedische Krone | 2.044.431 | (13.719.192) | 27.678 | (3.511) | 49.257 | (863) |
| Schweizer Franken | 6.550.148 | 2.100.001 | - | - | 28 | 25 |
| Thailändischer Baht | - | - | 74.428.877 | 125.999.885 | 18.604.820 | 20.526.474 |
| Türkische Lira | - | - | 20.116.212 | 18.221.312 | 4.286.125 | 3.192.431 |
| Uganda-Schilling | - | - | 5.747.020 | 7.308.984 | 1.119.625 | 1.090.702 |
| US-Dollar | 2.099.011.154 | 2.050.660.667 | 127.794.917 | 109.263.391 | 252.061.592 | 230.090.129 |
| Uruguayischer Peso | - | - | 13.819.761 | 2.636.726 | 2.816.774 | 600.568 |
| Sambischer Kwacha | - | - | 4.493.813 | 2.727.825 | 1.720.439 | 432.974 |
| | 2.649.818.655 | 2.491.704.928 | 1.285.867.647 | 1.386.264.443 | 526.787.807 | 470.181.480 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

| | Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | | Emerging Markets Equity | | Emerging Markets Select Equity [†] | |
|---------------------------------------|---|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|---|-------------------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 US\$ | Zum 31. Dezember 2022 US\$ | Zum 31. Dezember 2023 US\$ | Zum 31. Dezember 2022 US\$ | Zum 31. Dezember 2023 US\$ | Zum 31. Dezember 2022 US\$ |
| Australischer Dollar | 371.064 | 104.537 | 78.109 | 64.457 | - | - |
| Brasilianischer Real | - | - | 4.904.069 | 7.586.762 | - | 2.794.924 |
| Kanadischer Dollar | 2 | 1 | 779.818 | 1.755.366 | - | 7 |
| Chilenischer Peso | 367.546 | 339.178 | - | - | - | - |
| Chinesischer Yuan Renminbi | - | 2.031.464 | 50 | 30.079 | - | 70.634 |
| Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore | - | 748 | 4.639.922 | 22.323.932 | - | 9.438.596 |
| Kolumbianischer Peso | 1.752.964 | 831.596 | - | - | - | - |
| Tschechische Krone | 1.099.304 | 869.272 | - | - | - | - |
| Euro | 16.572.344 | 13.937.885 | 48.711 | 137.273 | - | 16.195 |
| Hongkong-Dollar | - | - | 10.159.509 | 37.056.247 | 6 | 19.787.831 |
| Ungarischer Forint | 788.480 | 124.597 | 1.548.412 | 2.147.618 | - | - |
| Indische Rupie | 356 | - | 16.883.306 | 32.037.144 | 4.019 | 7.573.691 |
| Indonesische Rupiah | 3.396.336 | 2.268.124 | 1.597.980 | 2.888.935 | - | 2.132.626 |
| Israelischer Schekel | (43.103) | (10.118) | - | - | - | - |
| Malaysischer Ringgit | 2.398.875 | 2.125.633 | - | - | - | - |
| Mexikanischer Peso | 3.245.080 | 2.639.163 | 2.935.064 | 2.869.765 | - | 1.624.815 |
| Neuer taiwanesischer Dollar | (787) | (2.682) | 6.668.816 | 11.838.081 | - | 13.804.257 |
| Norwegische Krone | 1.800.411 | 193.954 | - | - | - | - |
| Peruanischer Sol | 575.602 | 287.425 | - | - | - | - |
| Philippinischer Peso | 88.006 | 550 | 1.605.757 | - | - | - |
| Polnischer Zloty | 1.875.905 | 1.317.294 | 986.888 | 2.615.812 | - | 1.515.263 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

| | Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend (Fortsetzung) | | Emerging Markets Equity (Fortsetzung) | | Emerging Markets Select Equity* (Fortsetzung) | |
|-----------------------|---|-----------------------|---------------------------------------|-----------------------|---|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Britisches Pfund | (4) | (3) | 2.349.824 | 4.164.338 | - | 1.390.901 |
| Katar-Rial | - | - | - | 1.894.532 | - | 1.034.075 |
| Rumänischer Leu | 821.254 | 719.940 | - | - | - | - |
| Russischer Rubel | - | - | 2.953 | 3.617 | - | - |
| Saudi-Riyal | - | - | 4.003.118 | 6.654.852 | - | 1.405.056 |
| Singapur-Dollar | (365) | 790 | 2 | 2 | - | 1 |
| Südafrikanischer Rand | - | - | 1.129.877 | 6.019.825 | - | 3.006.541 |
| Südkoreanischer Won | 45.767 | 5.962 | 10.463.980 | 21.091.276 | - | 11.734.068 |
| Thailändischer Baht | 1.961.700 | 1.609.126 | 846.746 | 992.701 | - | 756.239 |
| VAE-Dirham | - | - | 1.522.140 | 2.750.497 | - | 1.362.386 |
| US-Dollar | 27.719.825 | 24.861.201 | 17.532.450 | 24.884.644 | (4.025) | 14.314.016 |
| Uruguayischer Peso | 230.987 | 18.744 | - | - | - | - |
| | 65.067.549 | 54.274.381 | 90.687.501 | 191.807.755 | - | 93.762.122 |

* Das Portfolio wurde am 7. September 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

| | Euro Bond | | Euro Bond Absolute Return | | European High Yield Bond | |
|--------------------|-----------------------|-----------------------|---------------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR |
| Kanadischer Dollar | - | - | (33.762) | (21.682) | - | - |
| Tschechische Krone | - | - | (10.856) | - | - | - |
| Dänische Krone | - | - | 1.314.701 | 995.379 | - | - |
| Euro | 10.582.522 | 9.306.187 | 32.530.158 | 34.809.856 | 349.944.569 | 29.417.545 |
| Japanischer Yen | - | - | (13.946) | 7.513 | - | - |
| Polnischer Zloty | - | - | 984.735 | - | - | - |
| Britisches Pfund | (10.199) | (9.957) | 379.719 | (33.597) | 58.629.389 | 4.651.454 |
| Singapur-Dollar | - | - | - | - | 1 | (669) |
| Schweizer Franken | - | - | - | - | 60.870 | - |
| US-Dollar | 771 | (1.488) | (1.123.922) | 12.770.407 | (218.512) | (1.613.802) |
| | 10.573.094 | 9.294.742 | 34.026.827 | 48.527.876 | 408.416.317 | 32.454.528 |

| | European Sustainable Equity | | Event Driven ² | |
|-------------------|-----------------------------|-----------------------|---------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | EUR | EUR | US\$ | US\$ |
| Dänische Krone | 13.482.154 | 8.595.903 | - | - |
| Euro | 84.856.607 | 84.020.928 | 388 | - |
| Norwegische Krone | 5.211.792 | 7.133.296 | - | - |
| Britisches Pfund | 24.641.334 | 24.378.899 | 4.180.953 | 901.385 |
| Schwedische Krone | 10.498.832 | 13.773.626 | - | - |
| Schweizer Franken | 31.217.338 | 34.936.391 | - | - |
| US-Dollar | 2.189.494 | 3.015.187 | 122.230.807 | 40.545.287 |
| | 172.097.551 | 175.854.230 | 126.412.148 | 41.446.672 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

| | Global Bond | | Global Diversified Income FMP – 2024 | | Global Equity Megatrends | |
|---------------------------------------|-----------------------|-----------------------|--------------------------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Australischer Dollar | 1.431.666 | (76.731) | - | - | - | - |
| Brasilianischer Real | 17.869 | 1.366 | - | - | - | - |
| Kanadischer Dollar | 3.789.921 | 12.580.352 | - | - | 5.599.843 | 4.945.156 |
| Chilenischer Peso | 6.508 | 6.401 | - | - | - | - |
| Chinesischer Yuan Renminbi | 290.460 | 360.970 | - | - | - | - |
| Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore | 532 | (8.276) | - | - | - | - |
| Kolumbianischer Peso | 14.974 | (3.588) | - | - | - | - |
| Tschechische Krone | 9.743 | (37.717) | - | - | - | - |
| Dänische Krone | 998.642 | 22.251 | - | - | - | - |
| Euro | 26.722.896 | 21.955.385 | 92.813 | 163.266 | 239.151 | 8.867 |
| Hongkong-Dollar | 20 | 15.864 | 333 | 3.914 | - | - |
| Ungarischer Forint | 11.277 | 15.703 | - | - | - | - |
| Indonesische Rupiah | 2.382.231 | 1.151.870 | - | - | - | - |
| Israelischer Schekel | 13.308 | (1.874) | - | - | - | - |
| Japanischer Yen | 5.250.782 | 7.135.466 | - | - | - | - |
| Malaysischer Ringgit | 10.350 | 28.441 | - | - | - | - |
| Mexikanischer Peso | 830.191 | 2.869.583 | - | - | - | - |
| Neuseeländischer Dollar | 700.386 | 1.566.178 | - | - | - | - |
| Norwegische Krone | 172.901 | (14.416) | - | - | - | - |
| Peruanischer Sol | 2.612 | 6.187 | - | - | - | - |
| Polnischer Zloty | 279.797 | 33.154 | - | - | - | - |
| Britisches Pfund | 5.491.512 | 6.752.292 | 89.866 | 148.036 | 7.576.753 | 4.451.862 |
| Rumänischer Leu | 2.209 | - | - | - | - | - |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

| | Global Bond (Fortsetzung) | | Global Diversified Income FMP – 2024 (Fortsetzung) | | Global Equity Megatrends (Fortsetzung) | |
|-----------------------|---------------------------|-----------------------|--|-----------------------|--|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Singapur-Dollar | 8.072 | 19.850 | 98.708 | 208.355 | 444 | - |
| Südafrikanischer Rand | 1.055 | 4.487 | - | - | - | - |
| Südkoreanischer Won | 2.334.784 | 5.264.565 | - | - | - | - |
| Schwedische Krone | (130.289) | 104.449 | - | - | - | - |
| Schweizer Franken | 339.669 | 70.850 | - | - | - | - |
| Thailändischer Baht | 23.543 | 26.583 | - | - | - | - |
| Türkische Lira | - | (95) | - | - | - | - |
| US-Dollar | 57.735.179 | 74.961.746 | 155.917.933 | 159.872.515 | 131.066.665 | 69.938.480 |
| | 108.742.800 | 134.811.296 | 156.199.653 | 160.396.086 | 144.482.856 | 79.344.365 |

| | Global Flexible Credit Income | | Global High Yield SDG Engagement | | Global High Yield Sustainable Action* | |
|----------------------|-------------------------------|-----------------------|----------------------------------|-----------------------|---------------------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Australischer Dollar | - | - | 1.540 | 1.177 | - | - |
| Kanadischer Dollar | 316.595 | 78.451 | - | - | - | - |
| Euro | 60.909.348 | 51.658.875 | 95.970.028 | 48.374.732 | 501 | 3.481.434 |
| Britisches Pfund | 17.331.764 | 34.657.200 | 17.653.094 | 7.112.241 | 221 | 740.307 |
| Schweizer Franken | - | - | 5.650.537 | 1.822.577 | - | - |
| US-Dollar | 312.055.274 | 308.131.803 | 438.888.706 | 279.642.651 | (722) | 10.825.327 |
| | 390.612.981 | 394.526.329 | 558.163.905 | 336.953.378 | - | 15.047.068 |

* Das Portfolio wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

| | Global Investment Grade Credit | | Global Opportunistic Bond | | Global Real Estate Securities | |
|---------------------------------------|--------------------------------|-----------------------|---------------------------|-----------------------|-------------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Australischer Dollar | - | - | 1.180.612 | 123.667 | 1.038.540 | 1.286.976 |
| Brasilianischer Real | - | - | 34.023 | 16.533 | - | - |
| Kanadischer Dollar | 1.983.786 | 2.208.763 | (317.187) | (273.916) | 827.668 | 1.815.491 |
| Chilenischer Peso | - | - | 2.783 | 11.491 | - | - |
| Chinesischer Yuan Renminbi | - | - | 2.096.427 | 3.467.949 | - | - |
| Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore | - | - | (5.092) | (13) | - | - |
| Tschechische Krone | - | - | 499.862 | 299.742 | - | - |
| Euro | 17.251.644 | 17.356.141 | 23.915.436 | 31.829.021 | 1.659.999 | 2.647.086 |
| Hongkong-Dollar | - | - | - | - | 956.261 | 3.067.701 |
| Ungarischer Forint | - | - | 279.114 | 9 | - | - |
| Indonesische Rupiah | - | - | 1.596.994 | 330.337 | - | - |
| Japanischer Yen | - | - | 67.899 | (92.504) | 1.739.044 | 3.606.589 |
| Mexikanischer Peso | - | - | 2.810.772 | 1.478.309 | - | - |
| Neuseeländischer Dollar | - | - | 2.955.614 | 3.477.029 | - | - |
| Norwegische Krone | - | - | 15.024 | (43.838) | - | - |
| Polnischer Zloty | - | - | 867.678 | 271.645 | - | - |
| Britisches Pfund | 7.313.323 | 3.835.303 | 4.852.959 | 4.282.014 | 1.187.032 | 3.087.877 |
| Russischer Rubel | - | - | 1.700 | 2.082 | - | - |
| Singapur-Dollar | - | - | - | - | 734.860 | 1.500.210 |
| Südafrikanischer Rand | - | - | 3.123 | 18.875 | - | - |
| Südkoreanischer Won | - | - | 264.517 | (5.485) | - | - |
| Schwedische Krone | - | - | (360.388) | 17.291 | - | - |
| Schweizer Franken | - | - | (235.468) | 6.201 | 304.936 | - |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

| | Global Investment Grade Credit (Fortsetzung) | | Global Opportunistic Bond (Fortsetzung) | | Global Real Estate Securities (Fortsetzung) | |
|---------------------------------------|--|-----------------------|---|-----------------------|---|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Thailändischer Baht | - | - | 260.293 | 251.550 | - | - |
| Türkische Lira | - | - | - | (143) | - | - |
| US-Dollar | 60.229.072 | 62.508.435 | 24.623.068 | 30.637.597 | 12.011.673 | 22.010.490 |
| | 86.777.825 | 85.908.642 | 65.409.763 | 76.105.443 | 20.460.013 | 39.022.420 |
| | | | | | | |
| | Global Sustainable Equity | | Global Sustainable Value | | High Yield Bond | |
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Australischer Dollar | - | - | 1.682.064 | 1.196.879 | 4.335.505 | 4.321.856 |
| Brasilianischer Real | - | - | 572.497 | 266.033 | - | - |
| Kanadischer Dollar | - | - | 2.055.919 | 1.784.244 | 128.502 | 70.793 |
| Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore | - | - | - | - | 33.428 | 42.580 |
| Dänische Krone | 2.356.644 | 2.087.276 | 173 | 259.300 | - | - |
| Euro | 18.198.317 | 13.587.115 | 4.877.673 | 4.183.597 | 5.502.188 | 12.183.833 |
| Hongkong-Dollar | - | - | 1.646.067 | 1.631.458 | 982 | 22.474 |
| Indonesische Rupiah | - | - | 192.941 | 291.610 | - | - |
| Japanischer Yen | 2.808.506 | 1.579.691 | 3.141.435 | 2.696.880 | - | - |
| Mexikanischer Peso | - | - | 397.431 | 180.675 | - | - |
| Neuer taiwanesischer Dollar | - | - | 1.041.760 | 796.265 | - | - |
| Neuseeländischer Dollar | - | - | 110.971 | 63.032 | - | - |
| Norwegische Krone | 3.833.337 | 4.295.279 | 364.322 | 57.495 | - | - |
| Britisches Pfund | 4.551.411 | 4.182.652 | 2.682.617 | 2.197.074 | 11.900.302 | 37.568.566 |
| Singapur-Dollar | - | - | 245.967 | 1 | 1.044.422 | 1.099.758 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

| | Global Sustainable Equity (Fortsetzung) | | Global Sustainable Value (Fortsetzung) | | High Yield Bond (Fortsetzung) | |
|-----------------------|---|-----------------------|--|-----------------------|-------------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Südafrikanischer Rand | - | - | 199.376 | 370.132 | 5.521.118 | 6.026.874 |
| Südkoreanischer Won | - | - | 794.977 | 880.568 | - | - |
| Schwedische Krone | 4.357.993 | 3.754.629 | 133.988 | 383.756 | 4.148.246 | 320.183 |
| Schweizer Franken | 12.094.429 | 5.969.094 | 1.191.665 | 1.186.729 | 398.057 | 600.966 |
| US-Dollar | 106.372.658 | 96.122.463 | 34.134.051 | 29.598.713 | 2.218.797.969 | 2.236.493.829 |
| | 154.573.295 | 131.578.199 | 55.465.894 | 48.024.441 | 2.251.810.719 | 2.298.751.712 |

| | InnovAsia 5G | | Japan Equity Engagement | | Macro Opportunities FX | |
|---------------------------------------|-----------------------|-----------------------|-------------------------|-----------------------|------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | JPY | JPY | EUR | EUR |
| Australischer Dollar | 173.906 | - | - | - | 39.080 | 32.782 |
| Brasilianischer Real | - | - | - | - | (4.922) | (82.316) |
| Kanadischer Dollar | - | 2.183.240 | - | - | 67.179 | 135.641 |
| Chilenischer Peso | - | - | - | - | 5.001 | 24.906 |
| Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore | 1.007.839 | - | - | - | 1 | 5 |
| Tschechische Krone | - | - | - | - | (1.277) | (63.164) |
| Euro | 151.104 | 302.164 | 86.682.787 | (161.821.291) | 2.839.381 | 32.305.444 |
| Hongkong-Dollar | 1 | 212.641 | - | - | - | - |
| Ungarischer Forint | - | - | - | - | (5.196) | 9 |
| Indonesische Rupiah | - | - | - | - | (23) | - |
| Indische Rupie | 2.736.940 | 539.135 | - | - | - | - |
| Japanischer Yen | 6.224.863 | 3.906.632 | 16.084.253.643 | 20.705.605.935 | 45.896 | 37.140 |
| Malaysischer Ringgit | 481.076 | 319.895 | - | - | - | - |
| Mexikanischer Peso | - | - | - | - | (8.248) | (85.167) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

| | InnovAsia 5G (Fortsetzung) | | Japan Equity Engagement (Fortsetzung) | | Macro Opportunities FX (Fortsetzung) | |
|-----------------------------|----------------------------|-----------------------|---------------------------------------|-----------------------|--------------------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | JPY | JPY | EUR | EUR |
| Neuer taiwanesischer Dollar | 5.480.052 | 3.817.484 | - | - | - | - |
| Neuseeländischer Dollar | - | - | - | - | 44.056 | 303.668 |
| Norwegische Krone | - | - | - | - | (16.499) | 34.363 |
| Polnischer Zloty | - | - | - | - | (14.454) | 5 |
| Britisches Pfund | - | - | 6.592.286 | (1.117.058) | 46.828 | 173.711 |
| Singapur-Dollar | 591.839 | 551.007 | - | - | - | - |
| Südafrikanischer Rand | - | - | - | - | (10) | (2.834) |
| Südkoreanischer Won | 3.391.560 | 515.684 | - | - | (4) | (17.087) |
| Schwedische Krone | - | - | - | - | (10.349) | (594.217) |
| Schweizer Franken | 36.502 | 26.843 | - | - | 85.607 | 64.744 |
| Thailändischer Baht | 715.164 | - | - | - | - | - |
| Türkische Lira | - | - | - | - | - | 43 |
| US-Dollar | 2.230.179 | 1.980.961 | (1) | (1) | (230.241) | (757.520) |
| Vietnamesischer Dong | 549.095 | 393.307 | - | - | - | - |
| | 23.770.120 | 14.748.993 | 16.177.528.715 | 20.542.667.585 | 2.881.806 | 31.510.156 |

| | Multi-Asset Income* | | Next Generation Mobility | | Next Generation Space Economy ² | |
|----------------------|-----------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------------|--|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Australischer Dollar | (3) | 46.449 | 2 | 2 | - | - |
| Brasilianischer Real | - | 18.289 | - | - | - | - |
| Kanadischer Dollar | - | (3.708) | 923.624 | 2.312.662 | - | - |
| Chilenischer Peso | - | 1.288 | - | - | - | - |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

| | Multi-Asset Income* (Fortsetzung) | | Next Generation Mobility (Fortsetzung) | | Next Generation Space Economy ² (Fortsetzung) | |
|---------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------|--|-----------------------|--|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Chinesischer Yuan Renminbi | - | 18.884 | - | - | - | - |
| Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore | - | (5.958) | 821.040 | 1.537.306 | 291.964 | 103.745 |
| Tschechische Krone | - | (9.292) | - | - | - | - |
| Euro | - | 2.880.701 | 8.433.497 | 5.955.204 | 2.317.039 | 1.198.609 |
| Hongkong-Dollar | - | 99.369 | 3.492.481 | 3.880.770 | - | - |
| Ungarischer Forint | - | 1 | - | - | - | - |
| Japanischer Yen | - | 163.447 | 3.261.496 | 2.867.915 | 1.343.794 | 172.026 |
| Mexikanischer Peso | - | 1.396 | - | - | - | - |
| Neuer taiwanesischer Dollar | - | 23.212 | 1.653.606 | 1.016.740 | 190.613 | 134.550 |
| Neuseeländischer Dollar | - | 15.785 | - | - | - | - |
| Norwegische Krone | - | (4.986) | - | - | - | - |
| Polnischer Zloty | - | 1 | - | - | - | - |
| Britisches Pfund | - | 302.903 | 2 | 2 | 714.848 | 334.851 |
| Singapur-Dollar | - | 2 | 1 | 1 | 591.275 | 270.259 |
| Südafrikanischer Rand | - | 10.952 | - | - | - | - |
| Südkoreanischer Won | - | 31.143 | 1.389.795 | - | 1.016.292 | 288.684 |
| Schwedische Krone | - | 4.448 | 2.040.136 | 1.854.268 | - | - |
| Schweizer Franken | - | 46.820 | - | - | - | - |
| Türkische Lira | - | (15) | - | - | - | - |
| US-Dollar | 3 | 7.724.984 | 142.340.385 | 128.579.807 | 13.278.105 | 5.988.138 |
| | - | 11.366.115 | 164.356.065 | 148.004.677 | 19.743.930 | 8.490.862 |

* Das Portfolio wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

| | Responsible Asian Debt - Hard Currency | | Short Duration Emerging Market Debt | | Short Duration High Yield SDG Engagement | |
|---------------------------------------|--|-----------------------|-------------------------------------|-----------------------|--|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Australischer Dollar | - | - | 37.563 | 18.635 | 44.496 | 49.208 |
| Kanadischer Dollar | - | - | 8.966 | 21.567 | - | - |
| Chinesischer Yuan Renminbi | 74.865 | 2.211 | 34 | 35 | - | - |
| Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore | (24.478) | 37 | - | - | 5.857 | 6.127 |
| Euro | 2.144.445 | 650.316 | 413.407.394 | 316.112.981 | 4.239.741 | 4.043.064 |
| Hongkong-Dollar | - | - | - | - | 115 | 1.251 |
| Indische Rupie | 252 | - | - | - | - | - |
| Indonesische Rupiah | 7.163 | 237 | - | - | - | - |
| Japanischer Yen | - | - | 22.534.119 | 20.830.836 | 5.148.350 | 11.907.484 |
| Malaysischer Ringgit | 14.931 | 6.219 | - | - | - | - |
| Neuer taiwanesischer Dollar | (1.225) | (9.958) | - | - | - | - |
| Philippinischer Peso | 3.430 | - | - | - | - | - |
| Britisches Pfund | - | - | 2.818.335 | (13.828.802) | 5.454.935 | 3.863.852 |
| Singapur-Dollar | (561) | 1.046 | 825.980 | 1.448.291 | 288.185 | 92.456 |
| Südafrikanischer Rand | - | - | - | - | 397 | 401 |
| Südkoreanischer Won | 131.323 | 3.527 | - | - | - | - |
| Schwedische Krone | - | - | 27.309 | (5.841) | - | - |
| Schweizer Franken | - | - | 2.179.655 | (1.469.320) | 50.323 | 57.702 |
| Thailändischer Baht | 24.924 | 3.627 | - | - | - | - |
| US-Dollar | 61.566.795 | 20.968.947 | 3.512.930.212 | 4.801.533.368 | 729.202.048 | 536.352.134 |
| | 63.941.864 | 21.626.209 | 3.954.769.567 | 5.124.661.750 | 744.434.447 | 556.373.679 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

| | Strategic Income | | Sustainable Asia High Yield | | Sustainable Emerging Market Corporate Debt | |
|---------------------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------------------|--|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Australischer Dollar | 17.539.127 | 1.338.717 | - | - | - | - |
| Brasilianischer Real | (207.691) | (401.123) | - | - | - | - |
| Kanadischer Dollar | (679.684) | 427.290 | - | - | - | - |
| Chilenischer Peso | (27.980) | 21.849 | - | - | - | - |
| Chinesischer Yuan Renminbi | - | - | - | - | 114.325 | 152.101 |
| Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore | 4.155.778 | - | - | - | (319) | (713) |
| Kolumbianischer Peso | 2.188.592 | 1.400.056 | - | - | - | - |
| Tschechische Krone | (16.735) | 20.373 | - | - | - | - |
| Euro | 82.017.440 | 28.762.204 | 16.887 | 241.129 | 4.228.272 | 425.989 |
| Hongkong-Dollar | 29.305.731 | (2.375) | - | - | - | - |
| Ungarischer Forint | 2.681.198 | 1.858.183 | - | - | - | - |
| Indische Rupie | 512 | - | - | - | - | - |
| Indonesische Rupiah | 3.755.309 | 3.590.638 | - | - | - | - |
| Israelischer Schekel | 41 | (26.852) | - | - | - | - |
| Japanischer Yen | 5.449.718 | 21.384.616 | - | - | - | - |
| Malaysischer Ringgit | 4.587 | 11.371 | - | - | - | - |
| Mexikanischer Peso | 6.308.818 | 2.747.959 | - | - | 988 | 858 |
| Neuer taiwanesischer Dollar | 11.655 | 4.170 | - | - | - | - |
| Neuseeländischer Dollar | 147.133 | (59.525) | - | - | - | - |
| Norwegische Krone | (21.185) | 4.975 | - | - | - | - |
| Peruanischer Sol | 4.112.101 | 4.521.028 | - | - | - | - |
| Philippinischer Peso | 4.108 | - | - | - | - | - |
| Polnischer Zloty | 2.802.855 | 25.574 | - | - | - | - |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

| | Strategic Income (Fortsetzung) | | Sustainable Asia High Yield (Fortsetzung) | | Sustainable Emerging Market Corporate Debt (Fortsetzung) | |
|-----------------------|--------------------------------|-----------------------|---|-----------------------|--|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Britisches Pfund | 24.213.364 | 3.531.816 | 1.743 | 13.686 | 153 | (459) |
| Rumänischer Leu | 4.058.739 | 2.050 | - | - | - | - |
| Singapur-Dollar | 2.311.461 | 1.630.397 | - | - | 1 | 1 |
| Südafrikanischer Rand | 4.036.991 | 3.686.731 | - | - | - | - |
| Südkoreanischer Won | 15.532 | 19.745 | - | - | - | - |
| Schwedische Krone | 16.635 | - | - | - | 7.853 | (745) |
| Schweizer Franken | 15.397 | - | - | - | 591.230 | 198.563 |
| Thailändischer Baht | 27.359 | 2.455 | - | - | - | - |
| Türkische Lira | (30) | 1.678.824 | - | - | - | - |
| US-Dollar | 1.825.353.588 | 1.246.624.709 | 28.546.321 | 31.667.456 | 92.846.634 | 97.468.713 |
| Uruguayischer Peso | 23.117 | - | - | - | - | - |
| | 2.019.603.581 | 1.322.805.855 | 28.564.951 | 31.922.271 | 97.789.137 | 98.244.308 |

| | Sustainable Emerging Market Debt – Hard Currency ² | | Tactical Marco ¹ | | Ultra Short Term Euro Bond | |
|---------------------------------------|---|-----------------------|-----------------------------|-----------------------|----------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | EUR | EUR |
| Australischer Dollar | - | - | 10.952 | - | - | - |
| Chinesischer Yuan Renminbi | - | - | (164) | - | - | - |
| Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore | - | - | (40.687) | - | - | - |
| Euro | 167.811.670 | 46.512.189 | 99.373 | - | 995.051.895 | 827.689.558 |
| Japanischer Yen | - | - | (88.203) | - | - | - |
| Neuseeländischer Dollar | - | - | (27.209) | - | - | - |
| Norwegische Krone | - | - | 4 | - | - | - |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

| | Sustainable Emerging Market Debt – Hard Currency ² (Fortsetzung) | | Tactical Marco ¹ (Fortsetzung) | | Ultra Short Term Euro Bond (Fortsetzung) | |
|---------------------------------------|--|-----------------------|---|-----------------------|--|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | EUR | EUR |
| Britisches Pfund | - | - | (22.689) | - | (7.923) | (7.637) |
| Schweizer Franken | - | - | - | - | 163.831 | (131.943) |
| US-Dollar | 278.080.600 | 111.908.405 | 27.230.931 | - | (2.335.505) | (6.159.911) |
| | 445.892.270 | 158.420.594 | 27.162.308 | - | 992.872.298 | 821.390.067 |
| | Uncorrelated Strategies | | Uncorrelated Trading ² | | US Equity | |
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Australischer Dollar | (7.146.070) | (15.921.904) | - | (1.220.926) | - | - |
| Brasilianischer Real | (265.787) | 213.635 | - | (15.408) | - | - |
| Kanadischer Dollar | (11.290) | (1.326.573) | (1) | (677.683) | - | - |
| Chilenischer Peso | 14.787 | 569.854 | - | 26.136 | - | - |
| Chinesischer Yuan Renminbi | (980) | 6.864.978 | - | - | - | - |
| Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore | (148.818) | (41.686.510) | - | 58.578 | - | - |
| Kolumbianischer Peso | 16.372 | (16.602) | - | (1.474) | - | - |
| Tschechische Krone | 2.181.561 | 2.364.518 | - | 69 | - | - |
| Dänische Krone | (933.968) | 532.153 | - | 305.817 | - | - |
| Ägyptisches Pfund | 247.059 | 125.217 | - | - | - | - |
| Euro | 28.397.963 | 44.500.025 | (213) | 72.161.991 | - | - |
| Hongkong-Dollar | (20.735.526) | (29.747.726) | - | (3.019.116) | - | - |
| Ungarischer Forint | 1.255.125 | (7.589.014) | - | (16.124) | - | - |
| Indische Rupie | (182.551) | (390.252) | - | 2.039 | - | - |
| Indonesische Rupiah | - | (174.498) | - | - | - | - |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

| | Uncorrelated Strategies (Fortsetzung) | | Uncorrelated Trading ^{1,2} (Fortsetzung) | | US Equity (Fortsetzung) | |
|-----------------------------|---------------------------------------|-----------------------|---|-----------------------|-------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Israelischer Schekel | 4.184.528 | 4.743.336 | - | - | - | - |
| Japanischer Yen | 6.475.942 | 22.469.382 | - | 2.579.962 | 1.137.567 | 1.611.150 |
| Malaysischer Ringgit | 990 | 6.589 | - | (1.855) | - | - |
| Mexikanischer Peso | (3.119.203) | (846.328) | - | (1.358) | - | - |
| Neuer taiwanesischer Dollar | 1.950.580 | 643.394 | - | 48.871 | - | - |
| Neuseeländischer Dollar | 1.315.078 | (1.144.140) | - | (40.543) | - | - |
| Nigerianischer Naira | (523.007) | - | - | - | - | - |
| Norwegische Krone | (3.335.594) | (461.930) | - | (35.178) | - | - |
| Philippinischer Peso | 25.686 | (86.635) | - | - | - | - |
| Polnischer Zloty | 4.549.144 | (4.936.105) | - | (329) | - | - |
| Britisches Pfund | 92.344.789 | 146.277.813 | 1 | (3.452.419) | - | - |
| Singapur-Dollar | 387.816 | 113.781 | - | (1.979) | - | - |
| Südafrikanischer Rand | 12.493.962 | 984.523 | - | (65.216) | - | - |
| Südkoreanischer Won | 8.408.896 | 21.742.052 | - | 2.255.903 | - | - |
| Schwedische Krone | (1.353.332) | (2.850.273) | - | 41.680 | - | - |
| Schweizer Franken | (7.720.759) | (4.469.935) | 1 | 676.154 | - | - |
| Thailändischer Baht | (56.746) | (3.881) | - | - | - | - |
| Türkische Lira | (278.695) | 114.691 | - | 3.966 | - | - |
| US-Dollar | 1.508.263.469 | 2.989.873.347 | 212 | 642.331.152 | 48.064.582 | 29.853.679 |
| | 1.626.701.421 | 3.130.486.982 | - | 711.942.710 | 49.202.149 | 31.464.829 |

* Das Portfolio wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

| | US Equity Index PutWrite | | US Large Cap Value | | US Long Short Equity | |
|-------------------|--------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Euro | 341.554 | 465.872 | 1.793.476 | 1.103.186 | 4.152.987 | 6.721.254 |
| Britisches Pfund | 11.070.085 | 15.230.653 | (348.901) | 495.336 | 59.233 | 43.281 |
| Singapur-Dollar | 9.837 | 8.116 | - | - | 4.192 | 13.246 |
| Schweizer Franken | - | - | - | - | 12 | 11 |
| US-Dollar | 717.676.524 | 664.752.097 | 1.937.745.803 | 1.766.355.837 | 191.253.867 | 214.752.109 |
| | 729.098.000 | 680.456.738 | 1.939.190.378 | 1.767.954.359 | 195.470.291 | 221.529.901 |

| | US Multi Cap Opportunities | | US Real Estate Securities | | US Small Cap | |
|-----------------------|----------------------------|-----------------------|---------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Australischer Dollar | 124.577 | 92.774 | 726.863 | 709.236 | 307.996 | 136.215 |
| Kanadischer Dollar | - | - | - | - | 13.206 | 12.396 |
| Euro | 351.827 | 504.882 | 445.574 | 835.315 | 387.224 | 507.870 |
| Hongkong-Dollar | - | - | (119.662) | 43.005 | - | - |
| Britisches Pfund | - | - | - | - | 28.754 | 26.178 |
| Singapur-Dollar | 649.693 | 1.012.735 | 19.673 | 34.162 | - | - |
| Südafrikanischer Rand | 27.054 | 527.446 | 764.872 | 1.021.954 | (9.963) | 98.794 |
| Schweizer Franken | - | - | 97.941 | 101.404 | - | - |
| US-Dollar | 399.338.884 | 439.178.113 | 531.174.724 | 645.280.719 | 633.124.552 | 591.597.214 |
| | 400.492.035 | 441.315.950 | 533.109.985 | 648.025.795 | 633.851.769 | 592.378.667 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

| | US Small Cap Intrinsic Value | |
|------------------|------------------------------|-----------------------|
| | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2022 |
| | US\$ | US\$ |
| Japanischer Yen | 70.534 | - |
| Britisches Pfund | 198.725 | 207.132 |
| US-Dollar | 321.299.358 | 193.833.908 |
| | 321.568.617 | 194.041.040 |

¹ Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

² Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko

Die Portfolios können Anlagen in festverzinslichen Wertpapieren halten. Jegliche Veränderung des Zinssatzes bestimmter Wertpapiere kann zu fallenden oder steigenden Erträgen führen. Die Kurse der gehaltenen Wertpapiere werden durch inländische Zinssätze beeinflusst. Die Performance des Portfolios wird daher teilweise von der Fähigkeit abhängig sein, solche Zinssatzschwankungen vorwegzunehmen. Die Manager und die Sub-Investment-Manager steuern dieses Risiko anhand von Analysen der Duration und der Renditekurve, um die Durationspositionierung und die Struktur der Renditekurve festzulegen und zu überwachen.

Die Gesellschaft hat im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 53 Portfolios. Bei einundzwanzig der Portfolios waren die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten überwiegend in Dividendenpapieren und nichtverzinslichen Wertpapieren angelegt. Infolgedessen sind diese Portfolios keinen größeren Risiken durch Fluktuationen des herrschenden Marktzinsniveaus ausgesetzt.

Zum Jahresende investierten die unten in der Tabelle aufgeführten Portfolios vor allem in festverzinsliche und variabel verzinsliche Instrumente und sind somit den Auswirkungen der Schwankungen der aktuellen Zinssätze auf ihre jeweilige Finanzposition und die Cashflows ausgesetzt.

Basierend auf der Zusammensetzung der Portfolios zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 hätten bei einem Rückgang der Zinssätze um 0,50 % bei gleichzeitiger Konstanz aller anderen Variablen das Nettovermögen und die Veränderungen des Nettovermögens gemäß Gewinn- und Verlustrechnung ungefähr in dem Umfang zugenommen, wie in der nachstehenden Tabelle aufgeführt. Ein Anstieg der Zinssätze um 0,50 % hätte einen entgegengesetzten Effekt in gleicher Höhe gehabt.

| Portfolio | Währung | 31. Dezember 2023 | % des Nettovermögens | 31. Dezember 2022 | % des Nettovermögens |
|---|---------|-------------------|----------------------|-------------------|----------------------|
| China Bond | CNY | 5.023.639 | 1,09 % | 3.911.507 | 0,86 % |
| CLO Income | USD | 362.300 | 0,20 % | 299.108 | 0,22 % |
| Commodities ¹ | USD | 145.168 | 0,09 % | 60.966 | 0,07 % |
| Corporate Hybrid Bond | EUR | 24.235.812 | 1,30 % | 25.225.221 | 1,42 % |
| Developed Market FMP – 2027 ² | USD | 1.697.215 | 1,23 % | - | - |
| Emerging Market Debt - Hard Currency | USD | 87.547.569 | 3,30 % | 80.254.944 | 3,22 % |
| Emerging Market Debt - Local Currency | USD | 33.828.398 | 2,63 % | 37.789.578 | 2,73 % |
| Emerging Market Debt Blend | USD | 13.406.283 | 2,54 % | 12.264.416 | 2,61 % |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | USD | 2.032.707 | 3,12 % | 1.782.765 | 3,28 % |
| Euro Bond | EUR | 303.681 | 2,87 % | 236.325 | 2,54 % |
| Euro Bond Absolute Return | EUR | 457.788 | 1,35 % | 280.039 | 0,58 % |
| European High Yield Bond | EUR | 5.901.351 | 1,44 % | 547.332 | 1,69 % |
| Global Bond | USD | 3.523.906 | 3,24 % | 3.834.658 | 2,84 % |
| Global Diversified Income FMP – 2024 | USD | 230.333 | 0,15 % | 902.467 | 0,56 % |
| Global Flexible Credit Income | USD | 6.035.383 | 1,55 % | 3.518.113 | 0,89 % |
| Global High Yield SDG Engagement | USD | 9.292.202 | 1,66 % | 5.562.582 | 1,65 % |
| Global High Yield Sustainable Action* | USD | - | - | 276.978 | 1,84 % |
| Global Investment Grade Credit | USD | 2.583.049 | 2,98 % | 2.526.643 | 2,94 % |
| Global Opportunistic Bond | USD | 2.389.387 | 3,65 % | 2.504.123 | 3,29 % |
| High Yield Bond | USD | 37.191.056 | 1,65 % | 43.177.996 | 1,88 % |
| Macro Opportunities FX | EUR | 4.545 | 0,16 % | 77.127 | 0,24 % |
| Multi-Asset Income** | USD | - | - | 153.665 | 1,35 % |
| Responsible Asian Debt - Hard Currency | USD | 1.406.001 | 2,20 % | 457.101 | 2,11 % |
| Short Duration Emerging Market Debt | USD | 42.766.959 | 1,08 % | 51.673.561 | 1,01 % |
| Short Duration High Yield SDG Engagement | USD | 8.671.152 | 1,16 % | 6.681.961 | 1,20 % |
| Strategic Income | USD | 35.814.120 | 1,77 % | 34.630.321 | 2,62 % |
| Sustainable Asia High Yield | USD | 346.613 | 1,21 % | 407.994 | 1,28 % |
| Sustainable Emerging Market Corporate Debt | USD | 1.930.479 | 1,97 % | 2.037.865 | 2,07 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

| Portfolio (Fortsetzung) | Währung | 31. Dezember 2023 | % des Nettovermögens | 31. Dezember 2022 | % des Nettovermögens |
|---|---------|-------------------|----------------------|-------------------|----------------------|
| Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency ¹ | USD | 15.176.781 | 3,40 % | 5.249.224 | 3,31 % |
| Ultra Short Term Euro Bond | EUR | 4.724.589 | 0,48 % | 5.435.227 | 0,66 % |
| US Equity Index PutWrite | USD | 3.184.114 | 0,44 % | 3.224.547 | 0,47 % |
| US Long Short Equity | USD | 26.847 | 0,01 % | 403.583 | 0,18 % |

* Das Portfolio wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

** Das Portfolio wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

¹ Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

² Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

In den nachstehenden Tabellen sind die Zinsrisiken der betreffenden Portfolios zusammengefasst. Sie beinhalten die nicht-derivativen verzinslichen und unverzinslichen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Portfolios zu ihren jeweiligen beizulegenden Zeitwerten, klassifiziert nach Fälligkeitsterminen. Andere Beträge und Verbindlichkeiten unterliegen keinen Veränderungen von Zinssätzen.

China Bond

31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr CNY | 1 - 5 Jahre CNY | Über 5 Jahre CNY | Unverzinslich CNY | Insgesamt CNY |
|---|----------------------|--------------------|---------------------|----------------------|--------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 134.244.166 | 240.367.488 | 69.958.142 | – | 444.569.796 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 9.446.611 | – | – | – | 9.446.611 |
| Vermögenswerte insgesamt | 143.690.777 | 240.367.488 | 69.958.142 | – | 454.016.407 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 143.690.777 | 240.367.488 | 69.958.142 | – | 454.016.407 |

31. Dezember 2022

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr CNY | 1 - 5 Jahre CNY | Über 5 Jahre CNY | Unverzinslich CNY | Insgesamt CNY |
|---|----------------------|--------------------|---------------------|----------------------|--------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 139.734.420 | 234.837.039 | 50.592.395 | – | 425.163.854 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 22.788.957 | – | – | – | 22.788.957 |
| Vermögenswerte insgesamt | 162.523.377 | 234.837.039 | 50.592.395 | – | 447.952.811 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 162.523.377 | 234.837.039 | 50.592.395 | – | 447.952.811 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

CLO Income

31. Dezember 2023

| | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|--------------------|
| Umlaufvermögen | | | | | |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 4.994.906 | 3.895.503 | 155.791.572 | 12.221.060 | 176.903.041 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 12.287.210 | – | – | – | 12.287.210 |
| Vermögenswerte insgesamt | 17.282.116 | 3.895.503 | 155.791.572 | 12.221.060 | 189.190.251 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 17.282.116 | 3.895.503 | 155.791.572 | 12.221.060 | 189.190.251 |

31. Dezember 2022

| | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|--------------------|
| Umlaufvermögen | | | | | |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | – | – | 112.870.953 | – | 112.870.953 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 20.349.795 | – | – | – | 20.349.795 |
| Vermögenswerte insgesamt | 20.349.795 | – | 112.870.953 | – | 133.220.748 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 20.349.795 | – | 112.870.953 | – | 133.220.748 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Commodities¹

31. Dezember 2023

| | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|-------------------|
| Umlaufvermögen | | | | | |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 97.662.888 | 23.310.069 | – | – | 120.972.957 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 33.206.631 | – | – | – | 33.206.631 |
| Vermögenswerte insgesamt | 130.869.519 | 23.310.069 | – | – | 154.179.588 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 130.869.519 | 23.310.069 | – | – | 154.179.588 |

31. Dezember 2022

| | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|-------------------|
| Umlaufvermögen | | | | | |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 59.358.047 | 16.849.925 | – | – | 76.207.972 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 8.094.998 | – | – | – | 8.094.998 |
| Vermögenswerte insgesamt | 67.453.045 | 16.849.925 | – | – | 84.302.970 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 67.453.045 | 16.849.925 | – | – | 84.302.970 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Corporate Hybrid Bond

31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr EUR | 1 - 5 Jahre EUR | Über 5 Jahre EUR | Unverzinslich EUR | Insgesamt EUR |
|---|----------------------|--------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | – | – | 1.743.583.625 | 10.956.412 | 1.754.540.037 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 79.423.824 | – | – | – | 79.423.824 |
| Vermögenswerte insgesamt | 79.423.824 | – | 1.743.583.625 | 10.956.412 | 1.833.963.861 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 79.423.824 | – | 1.743.583.625 | 10.956.412 | 1.833.963.861 |

31. Dezember 2022

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr EUR | 1 - 5 Jahre EUR | Über 5 Jahre EUR | Unverzinslich EUR | Insgesamt EUR |
|---|----------------------|--------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | – | – | 1.648.318.515 | – | 1.648.318.515 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 124.965.163 | – | – | – | 124.965.163 |
| Vermögenswerte insgesamt | 124.965.163 | – | 1.648.318.515 | – | 1.773.283.678 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 124.965.163 | – | 1.648.318.515 | – | 1.773.283.678 |

Developed Market FMP – 2027²

31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr EUR | 1 - 5 Jahre EUR | Über 5 Jahre EUR | Unverzinslich EUR | Insgesamt EUR |
|---|----------------------|--------------------|---------------------|----------------------|--------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | – | 135.777.186 | – | – | 135.777.186 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 503.437 | – | – | – | 503.437 |
| Vermögenswerte insgesamt | 503.437 | 135.777.186 | – | – | 136.280.623 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 503.437 | 135.777.186 | – | – | 136.280.623 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Emerging Market Debt – Hard Currency

31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|----------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 69.873.754 | 338.390.937 | 2.118.360.675 | 17.580.000 | 2.544.205.366 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 2.306.275 | – | – | – | 2.306.275 |
| Vermögenswerte insgesamt | 72.180.029 | 338.390.937 | 2.118.360.675 | 17.580.000 | 2.546.511.641 |
| Kontenüberziehung | 31.716 | – | – | – | 31.716 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | 31.716 | – | – | – | 31.716 |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 72.148.313 | 338.390.937 | 2.118.360.675 | 17.580.000 | 2.546.479.925 |

31. Dezember 2022

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|----------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 60.531.284 | 259.378.034 | 1.973.089.093 | 16.110.000 | 2.309.108.411 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 107.924.157 | – | – | – | 107.924.157 |
| Vermögenswerte insgesamt | 168.455.441 | 259.378.034 | 1.973.089.093 | 16.110.000 | 2.417.032.568 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 168.455.441 | 259.378.034 | 1.973.089.093 | 16.110.000 | 2.417.032.568 |

Emerging Market Debt – Local Currency

31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|----------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 44.652.360 | 409.726.253 | 745.209.971 | 16.173.300 | 1.215.761.884 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 34.899.630 | – | – | – | 34.899.630 |
| Vermögenswerte insgesamt | 79.551.990 | 409.726.253 | 745.209.971 | 16.173.300 | 1.250.661.514 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 79.551.990 | 409.726.253 | 745.209.971 | 16.173.300 | 1.250.661.514 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Emerging Market Debt – Local Currency (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|----------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 68.217.227 | 437.615.624 | 815.481.065 | 15.136.550 | 1.336.450.466 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 12.401.585 | – | – | – | 12.401.585 |
| Vermögenswerte insgesamt | 80.618.812 | 437.615.624 | 815.481.065 | 15.136.550 | 1.348.852.051 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 80.618.812 | 437.615.624 | 815.481.065 | 15.136.550 | 1.348.852.051 |

Emerging Market Debt Blend

31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|--------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 16.974.932 | 144.936.438 | 317.740.980 | 14.297.035 | 493.949.385 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 15.095.815 | – | – | – | 15.095.815 |
| Vermögenswerte insgesamt | 32.070.747 | 144.936.438 | 317.740.980 | 14.297.035 | 509.045.200 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 32.070.747 | 144.936.438 | 317.740.980 | 14.297.035 | 509.045.200 |

31. Dezember 2022

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|--------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 9.270.322 | 121.904.154 | 306.840.370 | 13.380.558 | 451.395.404 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 4.035.002 | – | – | – | 4.035.002 |
| Vermögenswerte insgesamt | 13.305.324 | 121.904.154 | 306.840.370 | 13.380.558 | 455.430.406 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 13.305.324 | 121.904.154 | 306.840.370 | 13.380.558 | 455.430.406 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

31. Dezember 2023

| | Bis zu 1 Jahr | 1 - 5 Jahre | Über 5 Jahre | Unverzinslich | Insgesamt |
|---|---------------|-------------|--------------|---------------|------------|
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Umlaufvermögen | | | | | |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 1.497.397 | 11.238.841 | 45.591.084 | – | 58.327.322 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 2.754.078 | – | – | – | 2.754.078 |
| Vermögenswerte insgesamt | 4.251.475 | 11.238.841 | 45.591.084 | – | 61.081.400 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 4.251.475 | 11.238.841 | 45.591.084 | – | 61.081.400 |

31. Dezember 2022

| | Bis zu 1 Jahr | 1 - 5 Jahre | Über 5 Jahre | Unverzinslich | Insgesamt |
|---|---------------|-------------|--------------|---------------|------------|
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Umlaufvermögen | | | | | |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 517.189 | 8.561.955 | 40.718.771 | – | 49.797.915 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 3.413.071 | – | – | – | 3.413.071 |
| Vermögenswerte insgesamt | 3.930.260 | 8.561.955 | 40.718.771 | – | 53.210.986 |
| Kontenüberziehung | 12 | – | – | – | 12 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | 12 | – | – | – | 12 |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 3.930.248 | 8.561.955 | 40.718.771 | – | 53.210.974 |

Euro Bond

31. Dezember 2023

| | Bis zu 1 Jahr | 1 - 5 Jahre | Über 5 Jahre | Unverzinslich | Insgesamt |
|---|---------------|-------------|--------------|---------------|------------|
| | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR |
| Umlaufvermögen | | | | | |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 463.336 | 3.556.701 | 6.153.523 | – | 10.173.560 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 127.676 | – | – | – | 127.676 |
| Vermögenswerte insgesamt | 591.012 | 3.556.701 | 6.153.523 | – | 10.301.236 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 591.012 | 3.556.701 | 6.153.523 | – | 10.301.236 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Euro Bond (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr EUR | 1 - 5 Jahre EUR | Über 5 Jahre EUR | Unverzinslich EUR | Insgesamt EUR |
|---|----------------------|--------------------|---------------------|----------------------|------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 65.594 | 2.688.537 | 5.792.884 | – | 8.547.015 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 473.148 | – | – | – | 473.148 |
| Vermögenswerte insgesamt | 538.742 | 2.688.537 | 5.792.884 | – | 9.020.163 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 538.742 | 2.688.537 | 5.792.884 | – | 9.020.163 |

Euro Bond Absolute Return

31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr EUR | 1 - 5 Jahre EUR | Über 5 Jahre EUR | Unverzinslich EUR | Insgesamt EUR |
|---|----------------------|--------------------|---------------------|----------------------|-------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 298.150 | 9.792.927 | 23.081.964 | – | 33.173.041 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 460.317 | – | – | – | 460.317 |
| Vermögenswerte insgesamt | 758.467 | 9.792.927 | 23.081.964 | – | 33.633.358 |
| Kontenüberziehung | 412.247 | – | – | – | 412.247 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | 412.247 | – | – | – | 412.247 |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 346.220 | 9.792.927 | 23.081.964 | – | 33.221.111 |

31. Dezember 2022

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr EUR | 1 - 5 Jahre EUR | Über 5 Jahre EUR | Unverzinslich EUR | Insgesamt EUR |
|---|----------------------|--------------------|---------------------|----------------------|-------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 3.933.441 | 11.682.263 | 30.292.316 | – | 45.908.020 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 1.710.742 | – | – | – | 1.710.742 |
| Vermögenswerte insgesamt | 5.644.183 | 11.682.263 | 30.292.316 | – | 47.618.762 |
| Kontenüberziehung | 388 | – | – | – | 388 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | 388 | – | – | – | 388 |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 5.643.795 | 11.682.263 | 30.292.316 | – | 47.618.374 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

European High Yield Bond

31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr EUR | 1 - 5 Jahre EUR | Über 5 Jahre EUR | Unverzinslich EUR | Insgesamt EUR |
|---|----------------------|--------------------|---------------------|----------------------|--------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 5.157.916 | 222.392.136 | 159.423.752 | – | 386.973.804 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 16.624.528 | – | – | – | 16.624.528 |
| Vermögenswerte insgesamt | 21.782.444 | 222.392.136 | 159.423.752 | – | 403.598.332 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 21.782.444 | 222.392.136 | 159.423.752 | – | 403.598.332 |

31. Dezember 2022

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr EUR | 1 - 5 Jahre EUR | Über 5 Jahre EUR | Unverzinslich EUR | Insgesamt EUR |
|---|----------------------|--------------------|---------------------|----------------------|-------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 380.405 | 17.612.967 | 14.489.268 | – | 32.482.640 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 1.372.196 | – | – | – | 1.372.196 |
| Vermögenswerte insgesamt | 1.752.601 | 17.612.967 | 14.489.268 | – | 33.854.836 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 1.752.601 | 17.612.967 | 14.489.268 | – | 33.854.836 |

Event Driven¹

31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|--------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 115.039.719 | – | – | – | 115.039.719 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 13.500.176 | – | – | – | 13.500.176 |
| Vermögenswerte insgesamt | 128.539.895 | – | – | – | 128.539.895 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 128.539.895 | – | – | – | 128.539.895 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Event Driven¹ (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|-------------------|
| Umlaufvermögen | | | | | |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 33.823.354 | – | – | – | 33.823.354 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 6.873.963 | – | – | – | 6.873.963 |
| Vermögenswerte insgesamt | 40.697.317 | – | – | – | 40.697.317 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 40.697.317 | – | – | – | 40.697.317 |

Global Bond

31. Dezember 2023

| | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|--------------------|
| Umlaufvermögen | | | | | |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 1.825.203 | 18.329.072 | 87.118.370 | – | 107.272.645 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 1.162.072 | – | – | – | 1.162.072 |
| Vermögenswerte insgesamt | 2.987.275 | 18.329.072 | 87.118.370 | – | 108.434.717 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 2.987.275 | 18.329.072 | 87.118.370 | – | 108.434.717 |

31. Dezember 2022

| | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|--------------------|
| Umlaufvermögen | | | | | |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2.208.864 | 44.832.896 | 83.833.941 | – | 130.875.701 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 4.700.090 | – | – | – | 4.700.090 |
| Vermögenswerte insgesamt | 6.908.954 | 44.832.896 | 83.833.941 | – | 135.575.791 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 6.908.954 | 44.832.896 | 83.833.941 | – | 135.575.791 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Global Diversified Income FMP – 2024

31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|--------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 143.083.313 | – | 874.554 | – | 143.957.867 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 11.026.949 | – | – | – | 11.026.949 |
| Vermögenswerte insgesamt | 154.110.262 | – | 874.554 | – | 154.984.816 |
| Kontenüberziehung | 13 | – | – | – | 13 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | 13 | – | – | – | 13 |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 154.110.249 | – | 874.554 | – | 154.984.803 |

31. Dezember 2022

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|--------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 23.835.209 | 128.689.334 | 1.743.330 | – | 154.267.873 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 50.248.991 | – | – | – | 50.248.991 |
| Vermögenswerte insgesamt | 74.084.200 | 128.689.334 | 1.743.330 | – | 204.516.864 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 74.084.200 | 128.689.334 | 1.743.330 | – | 204.516.864 |

Global Flexible Credit Income

31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|--------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2.915.203 | 140.275.024 | 206.687.076 | 6.088.915 | 355.966.218 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 25.482.094 | – | – | – | 25.482.094 |
| Vermögenswerte insgesamt | 28.397.297 | 140.275.024 | 206.687.076 | 6.088.915 | 381.448.312 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 28.397.297 | 140.275.024 | 206.687.076 | 6.088.915 | 381.448.312 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Global Flexible Credit Income (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|--------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 1.261.296 | 83.431.268 | 265.368.388 | 5.585.898 | 355.646.850 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 10.118.861 | – | – | – | 10.118.861 |
| Vermögenswerte insgesamt | 11.380.157 | 83.431.268 | 265.368.388 | 5.585.898 | 365.765.711 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 11.380.157 | 83.431.268 | 265.368.388 | 5.585.898 | 365.765.711 |

Global High Yield SDG Engagement

31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|--------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 5.784.900 | 265.500.629 | 261.218.885 | – | 532.504.414 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 10.709.205 | – | – | – | 10.709.205 |
| Vermögenswerte insgesamt | 16.494.105 | 265.500.629 | 261.218.885 | – | 543.213.619 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 16.494.105 | 265.500.629 | 261.218.885 | – | 543.213.619 |

31. Dezember 2022

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|--------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 3.726.199 | 127.664.393 | 142.628.218 | – | 274.018.810 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 5.259.514 | – | – | – | 5.259.514 |
| Vermögenswerte insgesamt | 8.985.713 | 127.664.393 | 142.628.218 | – | 279.278.324 |
| Kontenüberziehung | 15 | – | – | – | 15 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | 15 | – | – | – | 15 |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 8.985.698 | 127.664.393 | 142.628.218 | – | 279.278.309 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Global High Yield Sustainable Action*

31. Dezember 2022

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|-------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 106.321 | 7.096.577 | 7.336.654 | – | 14.539.552 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 1.033.221 | – | – | – | 1.033.221 |
| Vermögenswerte insgesamt | 1.139.542 | 7.096.577 | 7.336.654 | – | 15.572.773 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 1.139.542 | 7.096.577 | 7.336.654 | – | 15.572.773 |

* Das Portfolio wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

Global Investment Grade Credit

31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|-------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 1.112.393 | 28.149.954 | 54.196.428 | – | 83.458.775 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 3.401.463 | – | – | – | 3.401.463 |
| Vermögenswerte insgesamt | 4.513.856 | 28.149.954 | 54.196.428 | – | 86.860.238 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 4.513.856 | 28.149.954 | 54.196.428 | – | 86.860.238 |

31. Dezember 2022

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|-------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 993.712 | 27.655.463 | 54.876.198 | – | 83.525.373 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 3.565.231 | – | – | – | 3.565.231 |
| Vermögenswerte insgesamt | 4.558.943 | 27.655.463 | 54.876.198 | – | 87.090.604 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 4.558.943 | 27.655.463 | 54.876.198 | – | 87.090.604 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Global Opportunistic Bond

31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|-------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 1.205.126 | 8.733.528 | 54.990.329 | 21.165 | 64.950.148 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 1.529.454 | – | – | – | 1.529.454 |
| Vermögenswerte insgesamt | 2.734.580 | 8.733.528 | 54.990.329 | 21.165 | 66.479.602 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 2.734.580 | 8.733.528 | 54.990.329 | 21.165 | 66.479.602 |

31. Dezember 2022

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|-------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2.329.048 | 20.667.995 | 52.201.854 | 1.801.216 | 77.000.113 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 5.863.263 | – | – | – | 5.863.263 |
| Vermögenswerte insgesamt | 8.192.311 | 20.667.995 | 52.201.854 | 1.801.216 | 82.863.376 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 8.192.311 | 20.667.995 | 52.201.854 | 1.801.216 | 82.863.376 |

High Yield Bond

31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|----------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 11.110.249 | 925.395.910 | 1.152.879.000 | 3.611.285 | 2.092.996.444 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 73.617.932 | – | – | – | 73.617.932 |
| Vermögenswerte insgesamt | 84.728.181 | 925.395.910 | 1.152.879.000 | 3.611.285 | 2.166.614.376 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 84.728.181 | 925.395.910 | 1.152.879.000 | 3.611.285 | 2.166.614.376 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

High Yield Bond (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|----------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | – | 772.189.089 | 1.323.830.144 | 18.294.706 | 2.114.313.939 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 134.476.435 | – | – | – | 134.476.435 |
| Vermögenswerte insgesamt | 134.476.435 | 772.189.089 | 1.323.830.144 | 18.294.706 | 2.248.790.374 |
| Kontenüberziehung | 149 | – | – | – | 149 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | 149 | – | – | – | 149 |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 134.476.286 | 772.189.089 | 1.323.830.144 | 18.294.706 | 2.248.790.225 |

Macro Opportunities FX

31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr EUR | 1 - 5 Jahre EUR | Über 5 Jahre EUR | Unverzinslich EUR | Insgesamt EUR |
|---|----------------------|--------------------|---------------------|----------------------|------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2.754.542 | – | – | – | 2.754.542 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 126.875 | – | – | – | 126.875 |
| Vermögenswerte insgesamt | 2.881.417 | – | – | – | 2.881.417 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 2.881.417 | – | – | – | 2.881.417 |

31. Dezember 2022

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr EUR | 1 - 5 Jahre EUR | Über 5 Jahre EUR | Unverzinslich EUR | Insgesamt EUR |
|---|----------------------|--------------------|---------------------|----------------------|-------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 32.136.143 | – | – | – | 32.136.143 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 131.107 | – | – | – | 131.107 |
| Vermögenswerte insgesamt | 32.267.250 | – | – | – | 32.267.250 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 32.267.250 | – | – | – | 32.267.250 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Multi-Asset Income*

31. Dezember 2022

| | Bis zu 1 Jahr | 1 - 5 Jahre | Über 5 Jahre | Unverzinslich | Insgesamt |
|---|------------------|----------------|------------------|------------------|-------------------|
| Umlaufvermögen | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | – | 944.744 | 4.255.409 | 3.815.441 | 9.015.594 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 1.795.321 | – | – | – | 1.795.321 |
| Vermögenswerte insgesamt | 1.795.321 | 944.744 | 4.255.409 | 3.815.441 | 10.810.915 |
| Kontenüberziehung | 3.963 | – | – | – | 3.963 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | 3.963 | – | – | – | 3.963 |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 1.791.358 | 944.744 | 4.255.409 | 3.815.441 | 10.806.952 |

* Das Portfolio wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

Responsible Asian Debt - Hard Currency

31. Dezember 2023

| | Bis zu 1 Jahr | 1 - 5 Jahre | Über 5 Jahre | Unverzinslich | Insgesamt |
|---|------------------|-------------------|-------------------|---------------|-------------------|
| Umlaufvermögen | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 6.946.823 | 21.342.143 | 31.925.189 | – | 60.214.155 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 2.708.868 | – | – | – | 2.708.868 |
| Vermögenswerte insgesamt | 9.655.691 | 21.342.143 | 31.925.189 | – | 62.923.023 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 9.655.691 | 21.342.143 | 31.925.189 | – | 62.923.023 |

31. Dezember 2022

| | Bis zu 1 Jahr | 1 - 5 Jahre | Über 5 Jahre | Unverzinslich | Insgesamt |
|---|------------------|------------------|-------------------|---------------|-------------------|
| Umlaufvermögen | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 524.835 | 6.412.192 | 13.244.028 | – | 20.181.055 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 1.180.261 | – | – | – | 1.180.261 |
| Vermögenswerte insgesamt | 1.705.096 | 6.412.192 | 13.244.028 | – | 21.361.316 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 1.705.096 | 6.412.192 | 13.244.028 | – | 21.361.316 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Short Duration Emerging Market Debt

31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|----------------------|----------------------|-----------------------|----------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 709.354.762 | 2.565.462.463 | 493.196.793 | 49.810.000 | 3.817.824.018 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 14.257.955 | – | – | – | 14.257.955 |
| Vermögenswerte insgesamt | 723.612.717 | 2.565.462.463 | 493.196.793 | 49.810.000 | 3.832.081.973 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 723.612.717 | 2.565.462.463 | 493.196.793 | 49.810.000 | 3.832.081.973 |

31. Dezember 2022

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|----------------------|----------------------|-----------------------|----------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 650.064.015 | 3.596.608.250 | 537.916.711 | 70.347.000 | 4.854.935.976 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 196.555.616 | – | – | – | 196.555.616 |
| Vermögenswerte insgesamt | 846.619.631 | 3.596.608.250 | 537.916.711 | 70.347.000 | 5.051.491.592 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 846.619.631 | 3.596.608.250 | 537.916.711 | 70.347.000 | 5.051.491.592 |

Short Duration High Yield SDG Engagement

31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|--------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 9.930.122 | 639.212.714 | 28.290.948 | 241.028 | 677.674.812 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 44.469.256 | – | – | – | 44.469.256 |
| Vermögenswerte insgesamt | 54.399.378 | 639.212.714 | 28.290.948 | 241.028 | 722.144.068 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 54.399.378 | 639.212.714 | 28.290.948 | 241.028 | 722.144.068 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|--------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 23.828.866 | 460.111.988 | 28.086.847 | 1.221.039 | 513.248.740 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 27.853.758 | – | – | – | 27.853.758 |
| Vermögenswerte insgesamt | 51.682.624 | 460.111.988 | 28.086.847 | 1.221.039 | 541.102.498 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 51.682.624 | 460.111.988 | 28.086.847 | 1.221.039 | 541.102.498 |

Strategic Income

31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|----------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 222.715.766 | 226.693.883 | 1.626.771.226 | 60.788.966 | 2.136.969.841 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 55.205.634 | – | – | – | 55.205.634 |
| Vermögenswerte insgesamt | 277.921.400 | 226.693.883 | 1.626.771.226 | 60.788.966 | 2.192.175.475 |
| Kontenüberziehung | 377 | – | – | – | 377 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | 377 | – | – | – | 377 |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 277.921.023 | 226.693.883 | 1.626.771.226 | 60.788.966 | 2.192.175.098 |

31. Dezember 2022

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|----------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 114.007.287 | 233.727.570 | 1.015.663.596 | 58.225.837 | 1.421.624.290 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 104.978.500 | – | – | – | 104.978.500 |
| Vermögenswerte insgesamt | 218.985.787 | 233.727.570 | 1.015.663.596 | 58.225.837 | 1.526.602.790 |
| Kontenüberziehung | 155 | – | – | – | 155 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | 155 | – | – | – | 155 |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 218.985.632 | 233.727.570 | 1.015.663.596 | 58.225.837 | 1.526.602.635 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Sustainable Asia High Yield

31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|-------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2.041.966 | 13.296.029 | 11.531.216 | – | 26.869.211 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 1.163.077 | – | – | – | 1.163.077 |
| Vermögenswerte insgesamt | 3.205.043 | 13.296.029 | 11.531.216 | – | 28.032.288 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 3.205.043 | 13.296.029 | 11.531.216 | – | 28.032.288 |

31. Dezember 2022

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|-------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 256.500 | 14.322.223 | 13.754.217 | – | 28.332.940 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 2.770.190 | – | – | – | 2.770.190 |
| Vermögenswerte insgesamt | 3.026.690 | 14.322.223 | 13.754.217 | – | 31.103.130 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 3.026.690 | 14.322.223 | 13.754.217 | – | 31.103.130 |

Sustainable Emerging Market Corporate Debt

31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|-------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 1.802.010 | 34.834.285 | 53.996.504 | – | 90.632.799 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 3.976.271 | – | – | – | 3.976.271 |
| Vermögenswerte insgesamt | 5.778.281 | 34.834.285 | 53.996.504 | – | 94.609.070 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 5.778.281 | 34.834.285 | 53.996.504 | – | 94.609.070 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Sustainable Emerging Market Corporate Debt (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|-------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 979.077 | 32.045.482 | 58.359.521 | – | 91.384.080 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 6.953.109 | – | – | – | 6.953.109 |
| Vermögenswerte insgesamt | 7.932.186 | 32.045.482 | 58.359.521 | – | 98.337.189 |
| Kontenüberziehung | 1.508.656 | – | – | – | 1.508.656 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | 1.508.656 | – | – | – | 1.508.656 |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 6.423.530 | 32.045.482 | 58.359.521 | – | 96.828.533 |

Sustainable Emerging Market Debt- Hard Currency¹

31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|--------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 1.961.557 | 28.611.823 | 385.228.828 | – | 415.802.208 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 7.042.532 | – | – | – | 7.042.532 |
| Vermögenswerte insgesamt | 9.004.089 | 28.611.823 | 385.228.828 | – | 422.844.740 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 9.004.089 | 28.611.823 | 385.228.828 | – | 422.844.740 |

31. Dezember 2022

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|--------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | – | 13.872.499 | 129.941.857 | – | 143.814.356 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 8.625.196 | – | – | – | 8.625.196 |
| Vermögenswerte insgesamt | 8.625.196 | 13.872.499 | 129.941.857 | – | 152.439.552 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 8.625.196 | 13.872.499 | 129.941.857 | – | 152.439.552 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Tactical Macro²

31. Dezember 2023

| | Bis zu 1 Jahr | 1 - 5 Jahre | Über 5 Jahre | Unverzinslich | Insgesamt |
|---|---------------|-------------|--------------|---------------|------------|
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| Umlaufvermögen | | | | | |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 22.994.103 | – | – | – | 22.994.103 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 3.554.300 | – | – | – | 3.554.300 |
| Vermögenswerte insgesamt | 26.548.403 | – | – | – | 26.548.403 |
| Kontenüberziehung | 68.223 | – | – | – | 68.223 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | 68.223 | – | – | – | 68.223 |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 26.480.180 | – | – | – | 26.480.180 |

Ultra Short Term Euro Bond

31. Dezember 2023

| | Bis zu 1 Jahr | 1 - 5 Jahre | Über 5 Jahre | Unverzinslich | Insgesamt |
|---|---------------|-------------|--------------|---------------|-------------|
| | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR |
| Umlaufvermögen | | | | | |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 151.715.505 | 550.851.730 | 261.634.553 | – | 964.201.788 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 11.222.572 | – | – | – | 11.222.572 |
| Vermögenswerte insgesamt | 162.938.077 | 550.851.730 | 261.634.553 | – | 975.424.360 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 162.938.077 | 550.851.730 | 261.634.553 | – | 975.424.360 |

31. Dezember 2022

| | Bis zu 1 Jahr | 1 - 5 Jahre | Über 5 Jahre | Unverzinslich | Insgesamt |
|---|---------------|-------------|--------------|---------------|-------------|
| | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR |
| Umlaufvermögen | | | | | |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 47.528.662 | 511.849.443 | 239.919.963 | – | 799.298.068 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 10.039.473 | – | – | – | 10.039.473 |
| Vermögenswerte insgesamt | 57.568.135 | 511.849.443 | 239.919.963 | – | 809.337.541 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 57.568.135 | 511.849.443 | 239.919.963 | – | 809.337.541 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Uncorrelated Strategies

31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|----------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 726.121.264 | 97.774.544 | 42.920.336 | 78.510.108 | 945.326.252 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 215.995.568 | – | – | – | 215.995.568 |
| Vermögenswerte insgesamt | 942.116.832 | 97.774.544 | 42.920.336 | 78.510.108 | 1.161.321.820 |
| Kontenüberziehung | 659 | – | – | – | 659 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | 659 | – | – | – | 659 |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 942.116.173 | 97.774.544 | 42.920.336 | 78.510.108 | 1.161.321.161 |

31. Dezember 2022

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|----------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 1.594.362.150 | 122.919.502 | 31.139.060 | 140.344.310 | 1.888.765.022 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 301.147.318 | – | – | – | 301.147.318 |
| Vermögenswerte insgesamt | 1.895.509.468 | 122.919.502 | 31.139.060 | 140.344.310 | 2.189.912.340 |
| Kontenüberziehung | 22.735 | – | – | – | 22.735 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | 22.735 | – | – | – | 22.735 |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 1.895.486.733 | 122.919.502 | 31.139.060 | 140.344.310 | 2.189.889.605 |

Uncorrelated Trading^{1*}

31. Dezember 2022

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|--------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 449.200.010 | 1.270.800 | 11.950.635 | 20.035.760 | 482.457.205 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 66.208.500 | – | – | – | 66.208.500 |
| Vermögenswerte insgesamt | 515.408.510 | 1.270.800 | 11.950.635 | 20.035.760 | 548.665.705 |
| Kontenüberziehung | 27.694 | – | – | – | 27.694 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | 27.694 | – | – | – | 27.694 |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 515.380.816 | 1.270.800 | 11.950.635 | 20.035.760 | 548.638.011 |

* Das Portfolio wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

US Equity Index PutWrite

31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|--------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 344.736.832 | 318.620.304 | – | – | 663.357.136 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 56.170.541 | – | – | – | 56.170.541 |
| Vermögenswerte insgesamt | 400.907.373 | 318.620.304 | – | – | 719.527.677 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 400.907.373 | 318.620.304 | – | – | 719.527.677 |

31. Dezember 2022

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|--------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 300.435.106 | 331.828.970 | – | – | 632.264.076 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 44.491.927 | – | – | – | 44.491.927 |
| Vermögenswerte insgesamt | 344.927.033 | 331.828.970 | – | – | 676.756.003 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 344.927.033 | 331.828.970 | – | – | 676.756.003 |

US Long Short Equity

31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|--------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | – | 1.381.526 | 6.776.840 | 170.117.450 | 178.275.816 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 4.926.902 | – | – | – | 4.926.902 |
| Vermögenswerte insgesamt | 4.926.902 | 1.381.526 | 6.776.840 | 170.117.450 | 183.202.718 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 4.926.902 | 1.381.526 | 6.776.840 | 170.117.450 | 183.202.718 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

US Long Short Equity (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Umlaufvermögen | Bis zu 1 Jahr US\$ | 1 - 5 Jahre US\$ | Über 5 Jahre US\$ | Unverzinslich US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|--------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | – | 2.652.603 | 5.751.595 | 159.755.260 | 168.159.458 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 34.444.171 | – | – | – | 34.444.171 |
| Vermögenswerte insgesamt | 34.444.171 | 2.652.603 | 5.751.595 | 159.755.260 | 202.603.629 |
| Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen) | – | – | – | – | – |
| Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen | 34.444.171 | 2.652.603 | 5.751.595 | 159.755.260 | 202.603.629 |

¹ Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

² Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko

Das Kreditrisiko (oder Ausfallrisiko) ist das Risiko, dass ein Emittent oder eine Gegenpartei einer gegenüber dem Fonds eingegangenen Verbindlichkeit nicht nachkommen kann. Der Fonds hat zum Grundsatz, Finanzinstrumente mit unterschiedlichen, bonitätsmäßig einwandfreien Gegenparteien einzugehen. Deshalb erwartet der Fonds keine wesentlichen Kreditverluste aus seinen Finanzinstrumenten. Der Manager bewertet die Kreditqualität der Gegenparteien, die von dem Fonds genutzt werden. Diese Bewertung beinhaltet mindestens eine anfängliche und eine jährliche Kreditbewertung auf Grundlage der Finanzdaten und/oder Ratings Dritter. Gegenparteien, die für Devisenterminkontrakte und andere außerbörsliche Derivategeschäfte (OTC-Derivate) genutzt werden, unterliegen einer strengeren Überwachung, zu der auch detaillierte Kreditprüfungen mit Ratings Dritter und/oder Faktoren wie Kapitalausstattung, die Qualität der Vermögenswerte, Qualität der Verwaltung, Gewinne und Liquidität gehören. Der Manager verfolgt zudem die Nachrichten aus dem Finanzsektor, um einen Überblick über Trends in Sektoren und Ereignisse zu bekommen, die einen direkten Einfluss auf spezielle Gegenparteien haben können.

Das maximale Kreditrisiko der Gesellschaft (wobei der Wert von gehaltenen Sicherheiten oder anderen Wertpapieren unberücksichtigt bleibt) in dem Fall, dass Gegenparteien ihren Verpflichtungen zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 in Bezug auf jede Klasse erfasster finanzieller Vermögenswerte, mit Ausnahme von Derivaten, nicht nachkommen, ist der Buchwert dieser Vermögenswerte gemäß Angabe in der Bilanz.

Transaktionen im Zusammenhang mit derivativen Finanzinstrumenten werden in der Regel mit Gegenparteien getätigt, mit denen das Portfolio Master Netting Agreements unterzeichnet hat. Master Netting Agreements sehen die Nettoabwicklung von Kontrakten mit derselben Gegenpartei bei einem Ausfall vor. Das mit derivativen finanziellen Vermögenswerten, die einer Master-Netting-Vereinbarung unterliegen, verbundene Kreditrisiko wird nur insoweit eliminiert, als dass gegenüber derselben Gegenpartei fällige finanzielle Verbindlichkeiten abgerechnet werden, nachdem die Vermögenswerte veräußert wurden. Das Risiko wird auch durch Sicherheiten gesteuert, auf die der Fonds bei einem Zahlungsausfall einer Gegenpartei ohne Rückgriff auf diese Gegenpartei sofortigen Zugriff hat.

Kassenbestände, die über in den Büchern von Brown Brothers Harriman & Co. („BBH“) geführte Konten gehalten werden, sind Verbindlichkeiten von BBH, während Kassenbestände, die über direkt in den Büchern einer Drittbank als Korrespondenzbank für Kassenbestände, einer Unterdepotbank oder eines Maklers geführte Konten gehalten werden (zusammen die „Vertreterkonten“), Verbindlichkeiten des Vertreters sind. Kassenbestände, die über Vertreterkonten gehalten werden, sind Verbindlichkeiten des Vertreters und begründen ein direktes Schuldner/Gläubiger-Verhältnis zwischen dem Vertreter und dem Fonds. Dementsprechend ist BBH dafür verantwortlich, bei der Verwaltung dieser Vertreterkonten, wenn sie den Vertreter ernannt hat (d. h. im Falle von Korrespondenzbanken für Kassenbestände und Unterdepotbanken), angemessene Sorgfalt walten zu lassen, haftet jedoch nicht für die Rückzahlung, wenn der Vertreter aufgrund eines Konkurses, einer Insolvenz oder aus anderen Gründen die Rückzahlung nicht leistet. Zum 31. Dezember 2023 lagen sämtliche als Tagesgelder gehaltenen Barmittel und Bankguthaben wie in Anmerkung 3 angegeben bei Drittinstituten. Barmittel und Barmitteläquivalente mit einem langfristigen Kreditrating von Investment Grade gemäß Standard & Poor's (31. Dezember 2022: gleich). BBH hat ein langfristiges Kreditrating von A+ (31. Dezember 2022: A+) gemäß Fitch-Rating.

Die Verwahrstelle muss sicherstellen, dass die gesetzliche Trennung der von ihr verwahrten unbaren Vermögenswerte eingehalten wird, dass diese Vermögenswerte auf treuhänderischer Basis gehalten werden und dass geeignete interne Kontrollsysteme vorhanden sind, so dass in den Aufzeichnungen klar die Art und Höhe aller verwahrten Vermögenswerte identifiziert werden. Als Verwahrstelle muss Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited („BBHTS“) das Eigentum jedes Vermögenswertes und den Aufbewahrungsort der Eigentumstitel für jeden Vermögenswert sicherstellen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Das zentrale Risiko für den Fonds bleibt das Kreditrisiko, d. h. dass der Manager einen Schuldtitel oder eine Anleihe eines bestimmten Emittenten erwirbt und sie sich nicht erwartungsgemäß entwickelt und entweder Zahlungen ausfallen oder ein erheblicher Rückgang des Sekundärmarktwerts eintritt.

Um dieses Risiko zu mindern, führt der Manager eine unabhängige Due-Diligence-Prüfung jedes Kreditnehmers durch und fokussiert sich auf stabile, leistungsfähige Anleihen mit soliden Erfolgsbilanzen über vorausgegangenen Konjunkturzyklen. Außerdem wird auch die Größe eines Emittenten berücksichtigt. Der Manager favorisiert weiterhin die größeren Emittenten auf dem Markt, die sich über ein Emissionsvolumen von mehr als 500 Mio. US\$ definieren. Hinter diesen Emittenten stehen breitere Konsortien, was die Liquidität auf dem Sekundärmarkt steigern kann. Der Manager filtert nicht nur kleinere Emittenten heraus, sondern schließt auch stark zyklische Branchen und Unternehmen mit begrenzter Ertragstransparenz aus seinem Anlageverfahren aus.

Wurde eine bestimmte Anlage getätigt, wird sie vom Manager überwacht. Es wird für jede Anlage fortlaufend ein Spektrum einschlägiger Daten überprüft, insbesondere maßgebliche Finanztreiber, Rohstoffpreise, Aktienkurse, aufsichtsrechtliche Entwicklungen, Finanzergebnisse, Pressemeldungen und Kommentare des Managements, um Hinweise auf eine Verschlechterung der Bonität zu erkennen.

Um dieses Risiko zusätzlich zu steuern, stellen die Direktoren sicher, dass der Manager die von den Direktoren festgelegten Richtlinien zu Anlagelimits und -einschränkungen einhält. Die Direktoren überwachen mit dem Manager auf jeder ihrer Sitzungen die Umsetzung und die Ergebnisse des Anlageverfahrens und sie überwachen ferner die Risikofaktoren für jedes Portfolio.

Bei den Wertpapieren, die BBH in Verwahrung hat, handelt es sich um Aktien, festverzinsliche Wertpapiere, Participatory Notes, ABS-Anleihen und REITs. Alle von BBH (als globale Unterdepotbank für und im Namen von BBHTS und zu Gunsten von deren jeweiligen Kunden) verwahrten Wertpapiere werden von den eigenen Vermögenswerten der BBH getrennt, ungeachtet dessen, ob sie im Tresor von BBH, auf separaten Konten in den Büchern ihrer Unterdepotbanken oder auf einem bei einer Wertpapiersammelbank (Central Securities Depository) geführten Konto gehalten werden. BBH führt für jeden Kunden in ihren Büchern sowie in den Büchern der Unterdepotbank auf dem lokalen Markt, wenn dies möglich ist, separate Konten. Als Verwahrstelle muss BBHTS auch sicherstellen, dass unbare Vermögenswerte auf treuhänderischer Basis über das Netzwerk globaler Unterdepotbanken der BBH gehalten werden.

Die Unterdepotbanken von BBH sind durch Verträge mit BBH und allgemein gemäß dem Gesetz verpflichtet, die Wertpapiere von Depotkunden getrennt vom allgemeinen Bankvermögen der Unterdepotbank zu verwahren.

BBH führt über ihre Network Management Group zu Beginn und danach auf laufender Basis Due-Diligence-Prüfungen bei den Unterdepotbanken in ihrem globalen Verwahrstellennetz durch. Diese Prüfungen beinhalten eine Beurteilung der Service-Standards, des Sachverstandes des Managements, der Marktinformationen, des Verwahrstellenbetriebs, der Berichts- und technologischen Kapazitäten der Unterdepotbank sowie Prüfungen in Bezug auf ihre Reputation und Bonität am Markt und ihr dauerhaftes Engagement im Bereich der Verwahrstellendienstleistungen.

Mit jeder Unterdepotbank werden ein Service Level Agreement sowie die üblichen vertraglichen Vereinbarungen getroffen und diese regelmäßig im Rahmen von Service Review Meetings, einschließlich Due-Diligence-Meetings vor Ort, überprüft.

Die Risk and Credit Group von BBH führt regelmäßig Finanzanalysen bei allen Unterdepotbanken durch und konzentriert sich dabei unter anderem auf die Kapitalausstattung, die Qualität der Vermögenswerte, Gewinne, Liquidität und Kredit-Ratings als wesentliche Kennzahlen. Diese Überprüfungen sind Bestandteil der Routineprüfungen, die BBH im Hinblick auf die finanzielle Stärke und Bonität einer Unterdepotbank vornimmt.

Die Manager überwacht das Risiko für die Gesellschaft gemäß den Richtlinien für OGAW-Fonds und berichtet den Direktoren auf regelmäßiger Basis.

Der Fonds investiert in Schuldtitel, die ein Bonitätsrating einer renommierten Ratingagentur erhalten können. Die Bonitätsratings in den nachstehenden Tabellen werden als Prozentsatz der festverzinslichen Wertpapiere berechnet, wenn ein wesentlicher Anteil des betreffenden Portfolios als festverzinsliche Wertpapiere gehalten wird. Ein Schuldtitel wird als Investment-Grade-Titel betrachtet, wenn er ein Bonitätsrating von BBB- oder höher von Standard & Poor's und von Baa3 oder höher von Moody's hat. Per 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 stellten sich die Engagements nach Bonitätsratings wie folgt dar:

China Bond

| Anlagen: | 31. Dezember 2023 CNY | 31. Dezember 2022 CNY |
|---|--------------------------|--------------------------|
| Einlagenzertifikate | 58.557.000 | 92.924.345 |
| Unternehmensanleihen | 290.154.114 | 272.165.839 |
| Staatsanleihen | 95.858.682 | 60.073.670 |
| Derivate | 185.388 | 1.181.877 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 9.446.611 | 22.788.957 |
| Forderungen gegenüber Brokern | 682.867 | 839.388 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

China Bond (Fortsetzung)

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2023 % | 31. Dezember 2022 % |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade | 41,43 | 19,36 |
| Ohne Investment Grade | 5,73 | 3,71 |
| Ohne Rating | 52,84 | 76,93 |
| Insgesamt | 100,00 | 100,00 |

CLO Income

| Anlagen: | 31. Dezember 2023 US\$ | 31. Dezember 2022 US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | 159.687.075 | 112.870.953 |
| Schatzwechsel | 4.994.906 | – |
| Derivate | (176.733) | 1.943.252 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 12.287.210 | 20.349.795 |
| Forderungen gegenüber Brokern | – | 320.000 |

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2023 % | 31. Dezember 2022 % |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade | 3,03 | 2,44 |
| Ohne Investment Grade | 96,97 | 97,56 |
| Insgesamt | 100,00 | 100,00 |

Commodities²

| Anlagen: | 31. Dezember 2023 US\$ | 31. Dezember 2022 US\$ |
|--|---------------------------|---------------------------|
| Agency Bonds | – | 10.530.836 |
| Unternehmensanleihen | 77.031.796 | 26.223.262 |
| Schatzwechsel | 43.941.161 | 39.453.874 |
| Derivate | 1.363.262 | 1.186.450 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 33.206.631 | 8.094.998 |
| Forderungen gegenüber Brokern | 7.330.000 | – |
| Verbindlichkeiten gegenüber Maklern | – | (5.450.000) |

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2023 % | 31. Dezember 2022 % |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade | 100,00 | 100,00 |
| Insgesamt | 100,00 | 100,00 |

² Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Corporate Hybrid Bond

| Anlagen: | 31. Dezember 2023 EUR | 31. Dezember 2022 EUR |
|---|--------------------------|--------------------------|
| Unternehmensanleihen | 1.743.583.625 | 1.638.001.345 |
| Derivate | 4.369.046 | (21.157.336) |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 79.423.824 | 124.965.163 |

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2023 % | 31. Dezember 2022 % |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade | 52,83 | 58,88 |
| Ohne Investment Grade | 47,17 | 43,54 |
| Ohne Rating | – | (2,42) |
| Insgesamt | 100,00 | 100,00 |

Developed Market FMP – 2027¹

| Anlagen: | 31. Dezember 2023 US\$ |
|---|---------------------------|
| Unternehmensanleihen | 135.777.186 |
| Derivate | 39.476 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 503.437 |

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2023 % |
|-----------------------|------------------------|
| Investment Grade | 78,86 |
| Ohne Investment Grade | 21,14 |
| Insgesamt | 100,00 |

¹ Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Emerging Market Debt - Hard Currency

| Anlagen: | 31. Dezember 2023 US\$ | 31. Dezember 2022 US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Unternehmensanleihen | 732.442.764 | 784.977.470 |
| Staatsanleihen | 1.794.182.602 | 1.508.020.941 |
| Derivate | 28.532.535 | 25.569.299 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 2.306.275 | 107.924.157 |
| Kontenüberziehung | (31.716) | – |
| Forderungen gegenüber Brokern | 22.175.962 | 3.276.177 |

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2023 % | 31. Dezember 2022 % |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade | 33,68 | 36,49 |
| Ohne Investment Grade | 65,67 | 59,84 |
| Ohne Rating | 0,65 | 3,67 |
| Insgesamt | 100,00 | 100,00 |

Emerging Market Debt - Local Currency

| Anlagen: | 31. Dezember 2023 US\$ | 31. Dezember 2022 US\$ |
|--|---------------------------|---------------------------|
| Einlagenzertifikate | – | 18.492.177 |
| Unternehmensanleihen | 41.825.600 | 22.468.723 |
| Staatsanleihen | 1.124.421.834 | 1.280.353.016 |
| Schatzwechsel | 33.341.150 | – |
| Derivate | 933.685 | (33.615.251) |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 34.899.630 | 12.401.585 |
| Forderungen gegenüber Brokern | 16.010.321 | 54.984.796 |
| Verbindlichkeiten gegenüber Maklern | (2.230.000) | (3.980.000) |

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2023 % | 31. Dezember 2022 % |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade | 83,77 | 50,41 |
| Ohne Investment Grade | 14,66 | 16,94 |
| Ohne Rating | 1,57 | 32,65 |
| Insgesamt | 100,00 | 100,00 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Emerging Market Debt Blend

| Anlagen: | 31. Dezember 2023 US\$ | 31. Dezember 2022 US\$ |
|--|---------------------------|---------------------------|
| Unternehmensanleihen | 148.077.852 | 149.902.253 |
| Staatsanleihen | 330.568.106 | 288.112.593 |
| Schatzwechsel | 1.006.392 | – |
| Derivate | 1.629.543 | (2.073.158) |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 15.095.815 | 4.035.002 |
| Forderungen gegenüber Brokern | 7.902.696 | 9.999.389 |
| Verbindlichkeiten gegenüber Maklern | (390.000) | (840.000) |

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2023 % | 31. Dezember 2022 % |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade | 63,64 | 46,74 |
| Ohne Investment Grade | 34,73 | 36,08 |
| Ohne Rating | 1,63 | 17,18 |
| Insgesamt | 100,00 | 100,00 |

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

| Anlagen: | 31. Dezember 2023 US\$ | 31. Dezember 2022 US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Unternehmensanleihen | 9.239.606 | 7.512.041 |
| Staatsanleihen | 48.266.565 | 42.285.874 |
| Schatzwechsel | 821.151 | – |
| Derivate | 2.496.697 | 557.983 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 2.754.078 | 3.413.071 |
| Kontenüberziehung | – | (12) |
| Forderungen gegenüber Brokern | 679.691 | 424.677 |

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2023 % | 31. Dezember 2022 % |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade | 99,70 | 84,73 |
| Ohne Investment Grade | – | 0,61 |
| Ohne Rating | 0,30 | 14,66 |
| Insgesamt | 100,00 | 100,00 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Euro Bond

| Anlagen: | 31. Dezember 2023 EUR | 31. Dezember 2022 EUR |
|---|--------------------------|--------------------------|
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | 4.100 | 462.816 |
| Unternehmensanleihen | 4.770.071 | 4.079.176 |
| Staatsanleihen | 5.399.389 | 4.005.023 |
| Derivate | (35.197) | (69.064) |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 127.676 | 473.148 |
| Forderungen gegenüber Brokern | 217.984 | 258.450 |

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2023 % | 31. Dezember 2022 % |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade | 89,48 | 68,11 |
| Ohne Investment Grade | 10,52 | 11,32 |
| Ohne Rating | – | 20,57 |
| Insgesamt | 100,00 | 100,00 |

Euro Bond Absolute Return

| Anlagen: | 31. Dezember 2023 EUR | 31. Dezember 2022 EUR |
|---|--------------------------|--------------------------|
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | 158.727 | 2.319.216 |
| Unternehmensanleihen | 18.558.164 | 23.938.251 |
| Staatsanleihen | 14.456.150 | 19.650.553 |
| Derivate | (1.402.468) | 332.738 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 460.317 | 1.710.742 |
| Kontenüberziehung | (412.247) | (388) |
| Forderungen gegenüber Brokern | 1.822.858 | 252.313 |

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2023 % | 31. Dezember 2022 % |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade | 87,19 | 66,92 |
| Ohne Investment Grade | 12,81 | 9,37 |
| Ohne Rating | – | 23,71 |
| Insgesamt | 100,00 | 100,00 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

European High Yield Bond

| Anlagen: | 31. Dezember 2023 EUR | 31. Dezember 2022 EUR |
|---|--------------------------|--------------------------|
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | 2.425.341 | 215.121 |
| Unternehmensanleihen | 384.433.736 | 32.065.000 |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen | 114.727 | 202.519 |
| Derivate | (620.006) | (1.854.475) |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 16.624.528 | 1.372.196 |

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2023 % | 31. Dezember 2022 % |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade | 4,64 | 7,10 |
| Ohne Investment Grade | 95,36 | 92,05 |
| Ohne Rating | – | 0,85 |
| Insgesamt | 100,00 | 100,00 |

Event Driven²

| Anlagen: | 31. Dezember 2023 US\$ | 31. Dezember 2022 US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Schatzwechsel | 115.039.719 | 33.823.354 |
| Derivate | 4.862.107 | 917.817 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 13.500.176 | 6.873.963 |

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2023 % | 31. Dezember 2022 % |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade | 100,00 | 100,00 |
| Insgesamt | 100,00 | 100,00 |

² Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

Global Bond

| Anlagen: | 31. Dezember 2023 US\$ | 31. Dezember 2022 US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Agency Bonds | 1.146.538 | 2.423.190 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | 10.864.506 | 8.861.707 |
| Unternehmensanleihen | 28.855.602 | 44.359.194 |
| Staatsanleihen | 42.481.574 | 53.670.009 |
| Mortgage-Backed Securities | 22.645.649 | 19.062.981 |
| Kommunalanleihen | 1.278.776 | 1.706.806 |
| Schatzwechsel | – | 791.814 |
| Derivate | 12.036 | 797.126 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 1.162.072 | 4.700.090 |
| Forderungen gegenüber Brokern | 802.148 | 376.572 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Global Bond (Fortsetzung)

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2023 % | 31. Dezember 2022 % |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade | 75,01 | 73,77 |
| Ohne Investment Grade | 0,68 | – |
| Ohne Rating | 24,31 | 26,23 |
| Insgesamt | 100,00 | 100,00 |

Global Diversified Income FMP – 2024

| Anlagen: | 31. Dezember 2023 US\$ | 31. Dezember 2022 US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Unternehmensanleihen | 123.463.985 | 150.336.737 |
| Staatsanleihen | 1.727.993 | 3.931.136 |
| Schatzwechsel | 18.765.889 | – |
| Derivate | 281.732 | 523.570 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 11.026.949 | 50.248.991 |
| Kontenüberziehung | (13) | – |

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2023 % | 31. Dezember 2022 % |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade | 84,08 | 62,01 |
| Ohne Investment Grade | 15,92 | 36,23 |
| Ohne Rating | – | 1,76 |
| Insgesamt | 100,00 | 100,00 |

Global Flexible Credit Income

| Anlagen: | 31. Dezember 2023 US\$ | 31. Dezember 2022 US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | 23.118.219 | 24.079.041 |
| Unternehmensanleihen | 296.273.462 | 316.164.124 |
| Staatsanleihen | 15.379.748 | 9.817.787 |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen | 15.105.874 | – |
| Derivate | 3.511.941 | 17.497.471 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 25.482.094 | 10.118.861 |
| Forderungen gegenüber Brokern | 3.225.584 | 5.284.784 |
| Verbindlichkeiten gegenüber Maklern | (200.000) | – |

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2023 % | 31. Dezember 2022 % |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade | 26,71 | 27,37 |
| Ohne Investment Grade | 72,28 | 71,41 |
| Ohne Rating | 1,01 | 1,22 |
| Insgesamt | 100,00 | 100,00 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Global High Yield SDG Engagement

| Anlagen: | 31. Dezember 2023 US\$ | 31. Dezember 2022 US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Unternehmensanleihen | 532.499.481 | 273.005.334 |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen | 4.933 | 1.013.476 |
| Derivate | 5.197.440 | 3.460.687 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 10.709.205 | 5.259.514 |
| Kontenüberziehung | – | (15) |

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2023 % | 31. Dezember 2022 % |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade | 2,38 | 1,24 |
| Ohne Investment Grade | 97,18 | 98,07 |
| Ohne Rating | 0,44 | 0,69 |
| Insgesamt | 100,00 | 100,00 |

Global High Yield Sustainable Action*

| Anlagen: | 31. Dezember 2023 US\$ | 31. Dezember 2022 US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Unternehmensanleihen | – | 14.443.671 |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen | – | 95.881 |
| Derivate | – | (350.409) |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 52.318 | 1.033.221 |

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2023 % | 31. Dezember 2022 % |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade | – | 2,45 |
| Ohne Investment Grade | – | 96,42 |
| Ohne Rating | – | 1,13 |
| Insgesamt | – | 100,00 |

* Der Global High Yield Sustainable Action wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

Global Investment Grade Credit

| Anlagen: | 31. Dezember 2023 US\$ | 31. Dezember 2022 US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Unternehmensanleihen | 81.376.321 | 80.767.363 |
| Staatsanleihen | 2.082.454 | 2.758.010 |
| Derivate | (1.106.335) | (1.626.695) |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 3.401.463 | 3.565.231 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Global Investment Grade Credit (Fortsetzung)

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2023 % | 31. Dezember 2022 % |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade | 98,32 | 98,19 |
| Ohne Investment Grade | 1,68 | 1,36 |
| Ohne Rating | – | 0,45 |
| Insgesamt | 100,00 | 100,00 |

Global Opportunistic Bond

| Anlagen: | 31. Dezember 2023 US\$ | 31. Dezember 2022 US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Agency Bonds | – | 307.820 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | 1.817.743 | 4.290.102 |
| Unternehmensanleihen | 27.412.055 | 35.431.699 |
| Staatsanleihen | 21.133.383 | 24.711.043 |
| Mortgage-Backed Securities | 14.565.802 | 10.458.233 |
| Derivate | (2.049.562) | (2.418.728) |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 1.529.454 | 5.863.263 |
| Forderungen gegenüber Brokern | 1.153.721 | 1.228.672 |

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2023 % | 31. Dezember 2022 % |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade | 52,33 | 44,28 |
| Ohne Investment Grade | 24,77 | 33,40 |
| Ohne Rating | 22,90 | 22,32 |
| Insgesamt | 100,00 | 100,00 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

High Yield Bond

| Anlagen: | 31. Dezember 2023 US\$ | 31. Dezember 2022 US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | 10.897.982 | 21.830.306 |
| Unternehmensanleihen | 1.999.177.351 | 1.982.553.426 |
| Staatsanleihen | 36.225.768 | – |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen | 43.084.058 | 91.635.501 |
| Derivate | 25.265.889 | 30.109.875 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 73.617.932 | 134.476.435 |
| Kontenüberziehung | – | (149) |
| Forderungen gegenüber Brokern | – | 300.000 |

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2023 % | 31. Dezember 2022 % |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade | 6,90 | 3,93 |
| Ohne Investment Grade | 92,07 | 95,03 |
| Ohne Rating | 1,03 | 1,04 |
| Insgesamt | 100,00 | 100,00 |

Macro Opportunities FX

| Anlagen: | 31. Dezember 2023 EUR | 31. Dezember 2022 EUR |
|---|--------------------------|--------------------------|
| Unternehmensanleihen | – | 24.967.521 |
| Staatsanleihen | 347.166 | 2.778.639 |
| Schatzwechsel | 2.407.376 | 4.389.983 |
| Derivate | 13.600 | (811.369) |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 126.875 | 131.107 |

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2023 % | 31. Dezember 2022 % |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade | 100,00 | 96,29 |
| Ohne Rating | – | 3,71 |
| Insgesamt | 100,00 | 100,00 |

Multi-Asset Income*

| Anlagen: | 31. Dezember 2023 US\$ | 31. Dezember 2022 US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Agency Bonds | – | 7.644 |
| Unternehmensanleihen | – | 4.880.908 |
| Staatsanleihen | – | 311.601 |
| Derivate | – | (431.372) |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 58.916 | 1.795.321 |
| Kontenüberziehung | – | (3.963) |
| Forderungen gegenüber Brokern | – | 628.167 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Multi-Asset Income* (Fortsetzung)

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2023 % | 31. Dezember 2022 % |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade | – | 32,33 |
| Ohne Investment Grade | – | 67,52 |
| Ohne Rating | – | 0,15 |
| Insgesamt | – | 100,00 |

* Der Multi-Asset Income wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

Responsible Asian Debt - Hard Currency

| Anlagen: | 31. Dezember 2023 US\$ | 31. Dezember 2022 US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Unternehmensanleihen | 45.692.223 | 18.090.069 |
| Staatsanleihen | 12.025.196 | 2.090.986 |
| Schatzwechsel | 2.496.736 | – |
| Derivate | 120.024 | (6.712) |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 2.708.868 | 1.180.261 |
| Forderungen gegenüber Brokern | 128.088 | 55.253 |

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2023 % | 31. Dezember 2022 % |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade | 75,65 | 70,75 |
| Ohne Investment Grade | 21,04 | 21,22 |
| Ohne Rating | 3,31 | 8,03 |
| Insgesamt | 100,00 | 100,00 |

Short Duration Emerging Market Debt

| Anlagen: | 31. Dezember 2023 US\$ | 31. Dezember 2022 US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Unternehmensanleihen | 2.406.487.373 | 3.527.685.607 |
| Staatsanleihen | 1.307.631.941 | 1.205.827.702 |
| Schatzwechsel | 53.894.704 | 51.075.667 |
| Derivate | 55.420.371 | 20.870.051 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 14.257.955 | 196.555.616 |
| Forderungen gegenüber Brokern | 5.350.000 | – |

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2023 % | 31. Dezember 2022 % |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade | 54,66 | 56,06 |
| Ohne Investment Grade | 43,56 | 40,46 |
| Ohne Rating | 1,78 | 3,48 |
| Insgesamt | 100,00 | 100,00 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Short Duration High Yield SDG Engagement

| Anlagen: | 31. Dezember 2023 US\$ | 31. Dezember 2022 US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Unternehmensanleihen | 664.013.737 | 477.638.711 |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen | 13.420.047 | 23.578.927 |
| Schatzwechsel | – | 10.810.063 |
| Derivate | 12.140.835 | 17.725.693 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 44.469.256 | 27.853.758 |

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2023 % | 31. Dezember 2022 % |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade | 3,73 | 3,70 |
| Ohne Investment Grade | 95,93 | 96,15 |
| Ohne Rating | 0,34 | 0,15 |
| Insgesamt | 100,00 | 100,00 |

Strategic Income

| Anlagen: | 31. Dezember 2023 US\$ | 31. Dezember 2022 US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Agency Bonds | 781.434 | 772.053 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | 211.031.917 | 105.467.359 |
| Unternehmensanleihen | 535.844.310 | 637.567.177 |
| Staatsanleihen | 175.669.880 | 243.357.365 |
| Mortgage-Backed Securities | 918.338.562 | 346.893.475 |
| Kommunalanleihen | 12.918.823 | 20.744.098 |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen | 429.819 | 579.804 |
| Schatzwechsel | 221.166.130 | 8.017.122 |
| Derivate | 930.018 | 19.437.605 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 55.205.634 | 104.978.500 |
| Kontenüberziehung | (377) | (155) |
| Forderungen gegenüber Brokern | 22.631.176 | 3.722.665 |
| Verbindlichkeiten gegenüber Maklern | (520.000) | (250.000) |

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2023 % | 31. Dezember 2022 % |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade | 36,88 | 42,53 |
| Ohne Investment Grade | 16,69 | 29,92 |
| Ohne Rating | 46,43 | 27,55 |
| Insgesamt | 100,00 | 100,00 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Sustainable Asia High Yield

| Anlagen: | 31. Dezember 2023 US\$ | 31. Dezember 2022 US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Unternehmensanleihen | 24.364.117 | 27.495.016 |
| Staatsanleihen | 2.505.094 | 837.924 |
| Derivate | (17.944) | 266.230 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 1.163.077 | 2.770.190 |
| Forderungen gegenüber Brokern | 108.311 | 58.035 |

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2023 % | 31. Dezember 2022 % |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade | 18,00 | 9,14 |
| Ohne Investment Grade | 76,61 | 70,09 |
| Ohne Rating | 5,39 | 20,77 |
| Insgesamt | 100,00 | 100,00 |

Sustainable Emerging Market Corporate Debt

| Anlagen: | 31. Dezember 2023 US\$ | 31. Dezember 2022 US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Unternehmensanleihen | 83.464.415 | 86.982.672 |
| Staatsanleihen | 7.168.384 | 4.401.408 |
| Derivate | 1.461.588 | 761.197 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 3.976.271 | 6.953.109 |
| Kontenüberziehung | – | (1.508.656) |
| Forderungen gegenüber Brokern | 425.554 | 166.695 |

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2023 % | 31. Dezember 2022 % |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade | 51,32 | 48,27 |
| Ohne Investment Grade | 46,60 | 46,64 |
| Ohne Rating | 2,08 | 5,09 |
| Insgesamt | 100,00 | 100,00 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency²

| Anlagen: | 31. Dezember 2023 US\$ | 31. Dezember 2022 US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Unternehmensanleihen | 28.120.429 | 7.708.197 |
| Staatsanleihen | 387.681.779 | 136.106.159 |
| Derivate | 10.665.593 | 2.895.404 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 7.042.532 | 8.625.196 |
| Forderungen gegenüber Brokern | 4.811.634 | 199.602 |
| Kreditratings der Schuldtitel | | |
| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2023 % | 31. Dezember 2022 % |
| Investment Grade | 37,18 | 40,50 |
| Ohne Investment Grade | 59,56 | 59,31 |
| Ohne Rating | 3,26 | 0,19 |
| Insgesamt | 100,00 | 100,00 |

² Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

Tactical Macro¹

| Anlagen: | 31. Dezember 2023 US\$ |
|---|---------------------------|
| Schatzwechsel | 22.994.103 |
| Derivate | 173.202 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 3.554.300 |
| Kontenüberziehung | (68.223) |
| Forderungen gegenüber Brokern | 526.958 |
| Kreditratings der Schuldtitel | |
| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2023 % |
| Investment Grade | 100,00 |
| Insgesamt | 100,00 |

¹ Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

Ultra Short Term Euro Bond

| Anlagen: | 31. Dezember 2023 EUR | 31. Dezember 2022 EUR |
|---|--------------------------|--------------------------|
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | 90.687.160 | 72.343.961 |
| Unternehmensanleihen | 789.167.617 | 670.503.994 |
| Staatsanleihen | 75.386.047 | 56.450.113 |
| Schatzwechsel | 8.960.964 | – |
| Derivate | (6.740.350) | (925.722) |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 11.222.572 | 10.039.473 |
| Forderungen gegenüber Brokern | 11.144.095 | 6.612.268 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Ultra Short Term Euro Bond (Fortsetzung)

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2023 % | 31. Dezember 2022 % |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade | 91,38 | 84,47 |
| Ohne Investment Grade | 7,69 | 12,72 |
| Ohne Rating | 0,93 | 2,81 |
| Insgesamt | 100,00 | 100,00 |

Uncorrelated Strategies

| Anlagen: | 31. Dezember 2023 US\$ | 31. Dezember 2022 US\$ |
|--|---------------------------|---------------------------|
| Unternehmensanleihen | 120.618.827 | 161.387.060 |
| Staatsanleihen | 38.964.571 | 4.218.750 |
| Schatzwechsel | 707.195.701 | 1.582.793.462 |
| Derivate | 30.977.706 | 177.192.829 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 215.995.568 | 301.147.318 |
| Kontenüberziehung | (659) | (22.735) |
| Forderungen gegenüber Brokern | 456.802.391 | 737.006.142 |
| Verbindlichkeiten gegenüber Maklern | – | (5.000) |

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2023 % | 31. Dezember 2022 % |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade | 81,99 | 90,53 |
| Ohne Investment Grade | 5,87 | 2,21 |
| Ohne Rating | 12,14 | 7,26 |
| Insgesamt | 100,00 | 100,00 |

Uncorrelated Trading^{2*}

| Anlagen: | 31. Dezember 2023 US\$ | 31. Dezember 2022 US\$ |
|--|---------------------------|---------------------------|
| Unternehmensanleihen | – | 13.221.435 |
| Schatzwechsel | – | 449.200.010 |
| Derivate | – | 56.910.001 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 198.922 | 66.208.500 |
| Kontenüberziehung | – | (27.694) |
| Forderungen gegenüber Brokern | – | 89.712.105 |
| Verbindlichkeiten gegenüber Maklern | – | (63.659) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Uncorrelated Trading^{2*} (Fortsetzung)

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2023 % | 31. Dezember 2022 % |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade | – | 97,14 |
| Ohne Investment Grade | – | 2,58 |
| Ohne Rating | – | 0,28 |
| Insgesamt | – | 100,00 |

² Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

* Der Uncorrelated Trading wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

US Equity Index PutWrite

| Anlagen: | 31. Dezember 2023 US\$ | 31. Dezember 2022 US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Staatsanleihen | 663.357.136 | 632.264.076 |
| Derivate | 6.338.906 | 2.309.131 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 56.170.541 | 44.491.927 |

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2023 % | 31. Dezember 2022 % |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade | 100,00 | 100,00 |
| Insgesamt | 100,00 | 100,00 |

US Long Short Equity

| Anlagen: | 31. Dezember 2023 US\$ | 31. Dezember 2022 US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Unternehmensanleihen | 7.670.535 | 8.400.448 |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen | 487.831 | – |
| Derivate | (4.829.968) | 8.094.369 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente | 4.926.902 | 34.444.171 |
| Forderungen gegenüber Brokern | 18.176.471 | 11.644.215 |

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2023 % | 31. Dezember 2022 % |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade | 87,43 | 59,83 |
| Ohne Investment Grade | 6,59 | 28,88 |
| Ohne Rating | 5,98 | 11,29 |
| Insgesamt | 100,00 | 100,00 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR**12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)****(e) Liquiditätsrisiko**

Die größten Liquiditätsrisiken des Fonds bestehen darin, die Aufträge von Anteilhabern zur Rücknahme zu erfüllen. Für den Fonds können täglich Barrücknahmen von rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen anfallen. Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile sind auf Verlangen nach Wahl des Inhabers auf Basis des Nettoinventarwerts je Anteil des Portfolio zum Zeitpunkt der Rücknahme zurückzunehmen. Dieses Risiko wird vom Fonds gemildert, indem er vorwiegend in Wertpapiere investiert, die an den anerkannten Märkten in OECD-Mitgliedstaaten und anderen Ländern notiert sind oder gehandelt werden. Dadurch bestehen die Vermögenswerte aus realisierbaren Wertpapieren, die jederzeit verkauft werden können. Des Weiteren begrenzen Sicherheitenvereinbarungen das Ausmaß, in dem Verbindlichkeiten an den Fonds ausgedehnt werden können. Darüber hinaus steht dem Fonds, wie in Anmerkung 19 dargestellt, eine zugesagte Liquiditätsfazilität zur Verfügung.

Finanzielle Verbindlichkeiten

Die Fälligkeitsgruppierung basiert auf der Restlaufzeit ab dem Ende des Berichtszeitraums bis zum vertraglichen Fälligkeitsdatum. Kann die Gegenpartei den Zahlungszeitpunkt auswählen, wird die Verbindlichkeit dem frühestmöglichen Zeitpunkt zugeordnet, zu dem der Fonds zur Zahlung aufgefordert werden kann.

Zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 war die überwiegende Mehrheit der Verbindlichkeiten aller Portfolios innerhalb eines Monats zahlbar. Zu den Fälligkeiten der derivativen finanziellen Verbindlichkeiten sehen Sie bitte die Aufstellung des Wertpapierbestands. Andere Verbindlichkeiten als derivative finanzielle Verbindlichkeiten sind innerhalb eines Monats fällig.

(f) Risiko im Zusammenhang mit dem Austausch des LIBOR

Viele Finanzinstrumente verwenden oder können einen variablen Zins auf Grundlage der London Interbank Offered Rate („LIBOR“) verwenden, der Referenzzinssatz, zu dem große internationale Banken ungesicherte Interbankkredite aufnehmen können. LIBOR ist eventuell ein wesentlicher Faktor bei der Bestimmung der Zahlungsverpflichtungen eines Fonds im Rahmen einer derivativen Anlage, den Finanzierungskosten des Fonds oder eines Wertes oder einer Rendite einer Anlage im Fond und kann eventuell auf eine andere Art und Weise verwendet werden, die die Anlageperformance des Fonds beeinflusst. Die Financial Conduct Authority des Vereinigten Königreichs gab das Auslaufen des LIBORS bekannt. Auch wenn viele LIBOR-Sätze ausliefen, wird bis Juni 2023 weiter eine Auswahl weit genutzter USD-LIBOR-Sätze veröffentlicht, um den Übergang zu erleichtern. Die Portfolios gehen eventuell Engagements in an den LIBOR gebundene Finanzinstrumente ein, um Zahlungsverpflichtungen, Finanzierungsbedingungen, Absicherungsstrategien oder den Anlagewert zu bestimmen. Der Übergang weg vom LIBOR könnte zu einer erhöhten Volatilität und Illiquidität an Märkten für Instrumente führen, deren Bedingungen aktuell den LIBOR enthalten und die Effizienz neuer abgeschlossener Absicherungen mindern.

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen

FRS 102 Section 11.27 zum „Zeitwert: Offenlegung“ erfordert die Offenlegung in Bezug auf die Zeitwerthierarchie, in der Zeitwertbewertungen für Aktiva und Passiva kategorisiert sind. Die Offenlegungen basieren auf einer Zeitwerthierarchie mit drei Stufen für die Eingangswerte, die zur Bewertung des Zeitwerts in Bewertungstechniken verwendet werden.

Der Fonds legt der Bewertung nach dem beizulegenden Zeitwert eine Zeitwerthierarchie zu Grunde, die die Bedeutung der zur Bewertung herangezogenen Parameter berücksichtigt. Die drei Stufen der Zeitwerthierarchie gemäß FRS 102 werden nachstehend beschrieben:

Stufe 1 – Unangepasste, auf aktiven Märkten notierte Preise, die zum Bewertungszeitpunkt für identische, unbeschränkte Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten verfügbar sind.

Stufe 2 – Bewertungsparameter, die für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit entweder direkt (d. h. als Preise) oder indirekt (d. h. abgeleitet aus Preisen) beobachtbar sind und die nicht der Stufe 1 angehören.

Stufe 3 – Bewertungsparameter für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit, die nicht auf beobachtbaren Marktdaten basieren (d. h. nicht beobachtbare Parameter). Nicht beobachtbare Preisparameter werden bei Anlagen und in Situationen herangezogen, bei denen keine oder nur eine geringe Marktaktivität für das Instrument vorhanden ist. Die zur Ermittlung des beizulegenden Zeitwerts herangezogenen Parameter erfordern ein hohes Maß an Verwaltung, Beurteilung und Schätzung. Da für diese Wertpapiere keine beobachtbaren Preise verfügbar sind, hätten die Portfolios gegebenenfalls Bewertungstechniken angewandt, um dem beizulegenden Zeitwert zu ermitteln.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Die Stufe in der Zeitwerthierarchie, der die Zeitwertbewertung in ihrer Gesamtheit zugeordnet wird, wird anhand des niedrigsten Bewertungsparameters festgelegt, der für die Zeitwertbewertung in ihrer Gesamtheit maßgeblich ist. Zu diesem Zweck wird die Maßgeblichkeit eines Parameters anhand der Zeitwertbewertung in ihrer Gesamtheit beurteilt. Werden zum Beispiel bei einer Zeitwertbewertung beobachtbare Parameter angewandt, die aufgrund von nicht beobachtbaren Parametern eine maßgebliche Anpassung erfordern, so ist diese Bewertung der Stufe 3 zuzuordnen.

Die Beurteilung der Maßgeblichkeit eines bestimmten Parameters für die Zeitwertbewertung in ihrer Gesamtheit erfordert Urteilsvermögen und die Abwägung von Faktoren, die für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit spezifisch sind.

Die Entscheidung, welche Parameter als beobachtbar gelten, erfordert beträchtliches Urteilsvermögen seitens des Managers. Als beobachtbare Parameter erachtet der Manager Marktdaten, die jederzeit verfügbar sind, auf Markttransaktionen basieren, nicht geschützt sind, regelmäßig veröffentlicht werden, transparent, überprüfbar, verlässlich und konsensgestützt sind und von unabhängigen Quellen bereitgestellt werden, die aktiv an dem betreffenden Markt beteiligt sind.

Der Wert der Anlagen der Portfolios in Aktien, börsengehandelten Indexfonds, Optionsscheinen und ge- und verkauften börsengehandelten Optionen, für die Marktnotierungen zugänglich sind, wird in der Regel durch die Einholung von Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern auf der Grundlage des letzten an einer Hauptbörse oder einem Hauptmarkt für dieses Wertpapier notierten Verkaufspreises ermittelt (Parameter der Stufe 1). An der NASDAQ gehandelte Wertpapiere werden normalerweise mit dem offiziellen NASDAQ-Schlusskurs („NOCP“) bewertet, der von der NASDAQ an jedem Geschäftstag bereitgestellt wird. Der NOCP ist der zuletzt gemeldete Kurs um 16:00:02 Uhr, Eastern Time, außer wenn dieser Kurs außerhalb der „internen“ Geld- und Briefkursspanne (d. h. der Geld- und Briefkurse, die sich die Händler gegenseitig beim Handel für ihre eigenen Konten nennen) liegt. In diesem Fall passt die NASDAQ den Kurs so an, dass er dem internen Geld- oder Briefkurs entspricht, je nachdem, welcher näher liegt. Aufgrund von Verzögerungen bei der Meldung von Transaktionen basiert der NOCP möglicherweise nicht auf dem Preis des letzten Geschäfts vor dem Marktschluss. Wenn es an einem bestimmten Tag keinen Verkauf eines Wertpapiers gibt, können die unabhängigen Pricing-Service-Anbieter das Wertpapier auf der Grundlage von Marktnotierungen bewerten.

Der Wert von Participatory Notes wird ermittelt, indem Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern eingeholt werden, die auf der zugrunde liegenden Aktien und dem anwendbaren Wechselkurs basieren (Inputfaktoren der Stufe 1).

Der Wert der Anlagen des Portfolios in Schuldtiteln wird in erster Linie durch die Einholung von Bewertungen unabhängiger Pricing-Service-Anbietern auf der Grundlage zugänglicher Mittelkurse bestimmt. Falls keine solchen verfügbar sind, werden Methoden genutzt, die verschiedene Überlegungen auf der Grundlage des Wertpapiertyps beinhalten (allgemein Inputfaktoren der Stufe 2). Wenn mehr als eine Marktnotierung für ein Wertpapier verfügbar ist, wird das Wertpapier auf Stufe 2 eingestuft. Neben der Berücksichtigung von Renditen oder Kursen von Wertpapieren vergleichbarer Qualität, des Kupons, der Laufzeit und des Typs, von Hinweisen auf Werte von Händlern und der allgemeinen Marktbedingungen werden im Folgenden weitere Parameter der Stufe 2 und damit verbundene Bewertungstechniken beschrieben, die von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern zur Bewertung bestimmter Arten, von den Portfolios gehaltenen Schuldtiteln verwendet werden:

Unternehmensanleihen. Zu den Parametern, die für die Bewertung von Unternehmensanleihen verwendet werden, gehören im Allgemeinen relevante Kreditinformationen, beobachtete Marktbewegungen, sektorrelevante Nachrichten, die Renditekurve der US-Staatsanleihen oder die relevante Benchmark-Renditekurve sowie andere Marktinformationen, zu denen die Renditekurve der Benchmark, gemeldete Transaktionen, Broker-Dealer-Quotierungen, Emittentenspreads, vergleichbare Wertpapiere und Referenzdaten, wie z. B. verfügbar Veröffentlichtungen im Bereich der Marktforschung („andere Marktinformationen“).

Wandelanleihen. Die zur Bewertung von Wandelanleihen (einschließlich CoCos) herangezogenen Parameter beinhalten gewöhnlich Daten zu den zugrunde liegenden Aktien, Wandelprämien, Kurse börsennotierter Anleihen und Vorzugsaktien und andere Marktinformationen. Darunter können gegebenenfalls Benchmarkkurven, Transaktionsausführungsdaten und Sensitivitätsanalysen sein.

US-Staatsanleihen. Die zur Bewertung von US-Staatsanleihen herangezogenen Parameter beinhalten gewöhnlich Notierungen verschiedener Inter-Dealer-Broker und andere Marktinformationen.

Quasistaatliche US-Wertpapiere. Die zur Bewertung quasistaatlicher US-Wertpapiere herangezogenen Parameter beinhalten gewöhnlich das Einholen von Benchmark-Notierungen und andere Marktinformationen.

Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS) und hypothekarisch besicherte Wertpapiere (MBS). Zu den Parametern, die für die Bewertung von forderungsbesicherten Wertpapieren und hypothekarisch besicherten Wertpapieren verwendet werden, gehören im Allgemeinen Modelle, die eine Reihe von Faktoren berücksichtigen, darunter: vorzeitige Rückzahlungen, Cashflows, Spreadanpassungen und andere Marktinformationen.

Hochzinstitel. Zu den Parametern, die für die Bewertung von Hochzinstiteln verwendet werden, gehören im Allgemeinen eine Reihe von emittentenbezogenen Beobachtungen von Aktien- und Credit-Default-Swap-Kurven sowie sonstige Marktinformationen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR**12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)****(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)**

Schwellenländeranleihen und ausländische Staatsanleihen. Zu den Parametern, die für die Bewertung von Schuldtiteln aus Schwellenländern und ausländischen Staatspapieren verwendet werden, gehören im Allgemeinen Händlernotierungen, Anleihemarktaktivitäten, diskontierte Cashflow-Modelle und andere relevante Informationen wie Kreditspreads, Benchmarkkurven und andere Marktinformationen.

Besicherte Schuldtitel (Collateralized Loan Obligations, CLOs). Der Wert besicherter Schuldtiteln wird vorrangig durch Cashflow-Daten, relevante Daten zur Preisgestaltung von Darlehen und Marktfragen (Informationen, die für ein Unternehmen, eine Branche oder einen Markt spezifischer sind als öffentliche Informationen) sowie durch das Research von Marktteilnehmern und Trading Desks bestimmt (Inputfaktoren der Stufe 2 oder 3).

Der Wert von Laufzeitkrediten wird in erster Linie durch Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern auf der Grundlage von Broker-Quotierungen ermittelt (im Allgemeinen Inputfaktoren der Stufe 2 oder 3, je nach Anzahl der verfügbaren Quotierungen).

Der Wert von Futures-Kontrakten wird ermittelt, indem Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern zum Abrechnungskurs bei Börsenschluss eingeholt werden (Inputfaktoren der Stufe 1).

Der Wert von Devisenterminkontrakten wird bestimmt, indem Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern eingeholt werden, die auf tatsächlich gehandelten Währungskursen in den Netzwerken dieser unabhängigen Dienste sowie auf anderen gehandelten und notierten Währungskursen basieren, die den Pricing-Service-Anbietern von führenden Marktteilnehmern zur Verfügung gestellt werden (Inputfaktoren der Stufe 2).

Der Wert von Credit Default Swaps wird ermittelt, indem Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern eingeholt werden. Dabei kommt ein Modell zum Einsatz, das eine Reihe von Faktoren berücksichtigt, darunter möglicherweise Ausfallwahrscheinlichkeiten, Kreditkurven, Wiedereinbringungsquoten und Cashflows (Inputfaktoren der Stufe 2).

Der Wert von Inflationswaps wird in erster Linie durch die Einholung von Bewertungen unabhängiger Pricing-Service-Anbieter unter Bezugnahme auf die zugrunde liegenden Inflationsraten einschließlich der prognostizierten erwarteten Inflationsrate und der jeweiligen Interbank Offered Forward Rate für den Tagessatz ermittelt. Der Barwert wird anhand der erwarteten Cashflows auf Basis der Swap-Parameter sowie unter Bezugnahme auf die zugrunde liegende Inflationserwartungskurve und den Referenzsatz berechnet (Inputfaktoren der Stufe 2).

Der Wert von Zinsswaps wird in erster Linie durch die Einholung von Bewertungen unabhängiger Pricing-Service-Anbietern auf der Grundlage von Referenzen zu den zugrunde liegenden Sätzen einschließlich des lokalen OIS (Overnight Index Swap) und des jeweiligen IBOR (Interbank Offered Forward) für den Tagessatz ermittelt. Der Barwert wird anhand der erwarteten Cashflows auf Basis der Swap-Parameter sowie unter Bezugnahme auf die zugrunde liegende Zinskurve und den Referenzzinssatz berechnet (Inputfaktoren der Stufe 2).

Der Wert von Total Return Swaps wird bestimmt, indem Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern unter Verwendung des zugrunde liegenden Vermögenswerts und des angegebenen Zinssatzes der Benchmark eingeholt werden (Inputfaktoren der Stufe 2).

Der Wert von Cross-Currency-Swaps wird durch die Einholung von Bewertungen unabhängiger Pricing-Service-Anbieter anhand des Barwerts der erwarteten Cashflows auf Basis der Swap-Parameter sowie unter Bezugnahme auf die zugrunde liegende Zinskurve und den Referenzzinssatz berechnet (Inputfaktoren der Stufe 2).

Der Wert von Volatility-Swaps wird in erster Linie durch die Einholung von Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern ermittelt und basiert auf einem vorab festgestellten Volatilitätsniveau gegenüber der tatsächlichen, über einen gewissen Zeitraum realisierten Volatilität auf Grundlage von Daten des Referenzwerts (Inputfaktoren der Stufe 2).

Der Wert von Variance-Swaps wird in erster Linie durch die Einholung von Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern ermittelt und basiert auf der in der Vergangenheit realisierten und der voraussichtlichen künftigen Varianz (oder fairen Varianz) des Referenzwerts (Inputfaktoren der Stufe 2).

Der Wert von Correlation-Swaps wird in erster Linie durch die Einholung von Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern ermittelt und basiert auf der Differenzen zwischen der realisierten Korrelation und einem festen Korrelationswert (Inputfaktoren der Stufe 2).

Der Wert von Differenzkontrakten („CFD“) wird in erster Linie durch die Einholung von Bewertungen unabhängiger Pricing-Service-Anbieter ermittelt, die auf der Bezugnahme auf den zugrunde liegenden Vermögenswert sowie den angegebenen Referenzzinssatz beruhen (Inputfaktoren der Stufe 2). Der Wert von Swaptions wird ermittelt, indem Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern oder von Gegenparteien zum Abrechnungskurs bei Börsenschluss eingeholt werden (Inputfaktoren der Stufe 2).

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Optionskontrakte, die im Freiverkehr gehandelt werden, werden generell auf der Grundlage von Notierungen bewertet, die von Broker-Dealern gestellt werden, oder von Preisen, die von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern bereitgestellt werden, welche eine Reihe von Methoden einsetzen, unter anderem simulierte Preismodelle und/oder Kurvenanpassung (Bootstrapping), was die Ermittlung des Barwerts der Kontrakte erleichtert. Die Preismodelle ziehen Parameter heran, die auf aktiv notierten Märkten beobachtet werden, wie Angaben zum Emittenten, Indizes, Spreads, Zinssätze, Renditekurven, Volatilitätsflächen und Wechselkurse (Inputfaktoren der Stufe 2).

Einlagenzertifikate werden zu fortgeschriebenen Anschaffungskosten bewertet (Parameter der Stufe 2).

Umgekehrte Pensionsgeschäfte werden von Pricing-Service-Anbietern zum Nennwert bewertet (Inputfaktoren der Stufe 2).

Der Manager hat einen Prozess entwickelt, um die von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern bereitgestellten Informationen für alle Arten von Wertpapieren regelmäßig zu überprüfen.

Anlagen in nicht börsengehandelte Investmentgesellschaften werden anhand des täglich berechneten Nettoinventarwerts („NIW“) pro Anteil des jeweiligen Fonds bewertet (Inputfaktoren der Stufe 2), sofern verfügbar.

Wenn keine Bewertung von einem unabhängigen Pricing-Service-Anbieter verfügbar ist oder wenn der Manager Grund zu der Annahme hat, dass die erhaltene Bewertung nicht dem Betrag entspricht, den ein Portfolio bei einem aktuellen Verkauf in einer ordnungsgemäßen Transaktion vernünftigerweise erwarten könnte, versucht der Manager, Quotierungen von Brokern oder Händlern einzuholen (sie werden im Allgemeinen je nach der Anzahl der verfügbaren Angebote als Inputfaktoren der Stufe 2 oder der Stufe 3 erachtet). Wenn solche Quotierungen nicht verfügbar sind, wird das Wertpapier anhand von Methoden bewertet, welche die Direktoren in dem guten Glauben genehmigt haben, dass die resultierende Bewertung den beizulegenden Zeitwert des Wertpapiers widerspiegelt.

Parameter und Annahmen, die bei der Bestimmung des beizulegenden Zeitwerts eines Wertpapiers auf der Grundlage von Inputfaktoren der Stufe 2 oder 3 berücksichtigt werden, gehören unter anderem die Art des Wertpapiers, die Anschaffungskosten des Wertpapiers, das Vorhandensein vertraglicher Beschränkungen für die Veräußerung des Wertpapiers, der Preis und der Umfang des öffentlichen Handels mit ähnlichen Wertpapieren des Emittenten oder vergleichbarer Unternehmen; Notierungen oder bewertete Preise von Broker-Dealern und/oder Pricing-Service-Anbietern; Informationen, die vom Emittenten und/oder von Analysten eingeholt wurden; eine Analyse der Abschlüsse des Unternehmens oder des Emittenten; eine Bewertung der Parameter, die den Emittenten beeinflussen, und des Marktes/der Märkte, auf dem/denen das Wertpapier gekauft und verkauft wird.

Der Wert der Anlagen der Portfolios in ausländischen Wertpapieren wird in der Regel mit denselben Bewertungsmethoden und Parametern wie bei anderen Portfolioanlagen und wie oben beschrieben bestimmt. Die in Landeswährung ausgedrückten Preise ausländischer Wertpapiere werden normalerweise von der Landeswährung in US-Dollar umgerechnet. Dabei werden die Wechselkurse um 16:00 Uhr Eastern Time an Tagen verwendet, an denen die New York Stock Exchange („NYSE“) für den Geschäftsverkehr geöffnet ist. Die Direktoren haben die Inanspruchnahme der Interactive Data Pricing & Reference Data LLC („ICE“) genehmigt, um bei der Ermittlung des beizulegenden Zeitwerts ausländischer Dividendenpapiere mitzuwirken, wenn Änderungen im Wert eines bestimmten Index andeuten, dass die Schlusskurse an den ausländischen Börsen ggf. nicht länger repräsentativ für den Preis sind, den ein Portfolio für diese Wertpapiere oder an Tagen erwarten könnte, wenn ausländische Märkte geschlossen und US-Märkte offen sind. In jedem dieser Fälle liefert ICE mittels einer statistischen Analyse historischer Korrelationen mehrerer Faktoren angepasste Kurse für bestimmte ausländische Dividendenpapiere (Inputfaktoren der Stufe 2). Die Direktoren haben zudem die Verwendung von ICE genehmigt, um die Preise ausländischer Schuldtiteln zu dem Zeitpunkt zu bewerten, zu dem der Anteilspreis eines Portfolios berechnet wird. ICE verwendet Benchmark-Spread- und Renditekurven und wertet die verfügbaren Marktaktivitäten vom lokalen Börsenschluss bis zu dem Zeitpunkt aus, zu dem der Anteilspreis eines Portfolios berechnet wird (Inputfaktoren der Stufe 2), um so bei der Ermittlung der Preise bestimmter ausländischer Schuldtitel zu helfen.

Sowohl bei ausländischen Aktien als auch bei ausländischen Schuldtiteln haben die Direktoren Mangels genauer Informationen über die Marktwerte dieser ausländischen Wertpapiere zu dem Zeitpunkt, wenn der Anteilspreis eines Portfolios berechnet wird anhand verfügbarer Daten entschieden, dass auf diese Art und Weise angepasste oder geschätzte Preise wahrscheinlich eher den Preisen entsprechen, die ein Portfolio bei einem aktuellen Verkauf erzielen könnte, als die Preise derjenigen Wertpapiere, die bei Börsenschluss der ausländischen Märkte ermittelt werden, auf denen die Wertpapiere vorwiegend gehandelt werden.

Preise zum beizulegenden Zeitwert sind notwendigerweise Schätzungen. Es gibt keine Gewähr, dass ein solcher Preis dem tatsächlichen Preis, zu dem das Wertpapier als nächstes notiert oder gehandelt wird, entspricht oder diesem nahe kommt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Die nachstehenden Tabellen zeigen Finanzanlagen nach den Stufen in der Zeitwerthierarchie:

5G Connectivity

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|--------------------|-------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | 963.698.691 | 26.816.617 | – | 990.515.308 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 6.342.222 | – | 6.342.222 |
| Vermögenswerte insgesamt | 963.698.691 | 33.158.839 | – | 996.857.530 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (1.033.321) | – | (1.033.321) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (1.033.321) | – | (1.033.321) |

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|
| Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 1 | | | |
| Aktien | 33.229.577 | (33.229.577) | – |

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurde eine Aktie von Stufe 2 in Stufe 1 übertragen, da die Preisfindung durch einen Pricing-Anbieter erfolgte.

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|--------------------|-------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | 884.202.753 | 68.691.966 | – | 952.894.719 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 12.141.765 | – | 12.141.765 |
| Vermögenswerte insgesamt | 884.202.753 | 80.833.731 | – | 965.036.484 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (3.280.059) | – | (3.280.059) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (3.280.059) | – | (3.280.059) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Absolute Return Multi Strategy*

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3** US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-------------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | – | – | 6.311 | 6.311 |
| Vermögenswerte insgesamt | – | – | 6.311 | 6.311 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3** US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-------------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | – | – | 6.766 | 6.766 |
| Vermögenswerte insgesamt | – | – | 6.766 | 6.766 |

* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

** Aktien der Stufe 3 wurden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren bewertet.

China A-Share Equity

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 CNY | Stufe 2 CNY | Stufe 3 CNY | Insgesamt CNY |
|---|-------------------|----------------|----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | 13.480.937 | – | – | 13.480.937 |
| Vermögenswerte insgesamt | 13.480.937 | – | – | 13.480.937 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 CNY | Stufe 2 CNY | Stufe 3 CNY | Insgesamt CNY |
|---|-------------------|----------------|----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | 15.264.413 | 53.280 | – | 15.317.693 |
| Vermögenswerte insgesamt | 15.264.413 | 53.280 | – | 15.317.693 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

China Bond

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 CNY | Stufe 2 CNY | Stufe 3 CNY | Insgesamt CNY |
|---|----------------|--------------------|----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Einlagenzertifikat | – | 58.557.000 | – | 58.557.000 |
| Unternehmensanleihen | – | 290.154.114 | – | 290.154.114 |
| Staatsanleihen | – | 95.858.682 | – | 95.858.682 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 1.943.751 | – | 1.943.751 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 603.582 | – | – | 603.582 |
| Vermögenswerte insgesamt | 603.582 | 446.513.547 | – | 447.117.129 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 CNY | Stufe 2 CNY | Stufe 3 CNY | Insgesamt CNY |
|--|----------------|--------------------|----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (2.361.945) | – | (2.361.945) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (2.361.945) | – | (2.361.945) |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 CNY | Stufe 2 CNY | Stufe 3 CNY | Insgesamt CNY |
|---|----------------|--------------------|----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Unternehmensanleihen | – | 272.165.839 | – | 272.165.839 |
| Einlagenzertifikate | – | 92.924.345 | – | 92.924.345 |
| Staatsanleihen | – | 60.073.670 | – | 60.073.670 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 3.921.557 | – | 3.921.557 |
| Vermögenswerte insgesamt | – | 429.085.411 | – | 429.085.411 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 CNY | Stufe 2 CNY | Stufe 3 CNY | Insgesamt CNY |
|--|-----------------|--------------------|----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (2.701.843) | – | (2.701.843) |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (37.837) | – | – | (37.837) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | (37.837) | (2.701.843) | – | (2.739.680) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

China Equity

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|--------------------|-----------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | 171.916.351 | – | – | 171.916.351 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 547.220 | – | 547.220 |
| Vermögenswerte insgesamt | 171.916.351 | 547.220 | – | 172.463.571 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (423.344) | – | (423.344) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (423.344) | – | (423.344) |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|--------------------|------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | 306.849.688 | – | – | 306.849.688 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 1.099.861 | – | 1.099.861 |
| Vermögenswerte insgesamt | 306.849.688 | 1.099.861 | – | 307.949.549 |
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (817.712) | – | (817.712) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (817.712) | – | (817.712) |

Climate Innovation¹

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|------------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | 2.603.137 | 228.261 | – | 2.831.398 |
| Vermögenswerte insgesamt | 2.603.137 | 228.261 | – | 2.831.398 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

CLO Income

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Schatzwechsel | – | 4.994.906 | – | 4.994.906 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | – | 159.687.075 | – | 159.687.075 |
| Investmentfonds | 12.221.060 | – | – | 12.221.060 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 2.345.289 | – | 2.345.289 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten | – | 48.732 | – | 48.732 |
| Vermögenswerte insgesamt | 12.221.060 | 167.076.002 | – | 179.297.062 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (2.570.754) | – | (2.570.754) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (2.570.754) | – | (2.570.754) |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | – | 112.870.953 | – | 112.870.953 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 3.267.421 | – | 3.267.421 |
| Vermögenswerte insgesamt | – | 116.138.374 | – | 116.138.374 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (989.846) | – | (989.846) |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten | – | (334.323) | – | (334.323) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (1.324.169) | – | (1.324.169) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Commodities²

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Schatzwechsel | – | 43.941.161 | – | 43.941.161 |
| Unternehmensanleihen | – | 77.031.796 | – | 77.031.796 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 1.573.388 | – | 1.573.388 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten | – | 0 | – | 0 |
| Vermögenswerte insgesamt | – | 122.546.345 | – | 122.546.345 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (210.126) | – | (210.126) |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten | – | (0) | – | (0) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (210.126) | – | (210.126) |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Agency Bonds | – | 10.530.836 | – | 10.530.836 |
| Unternehmensanleihen | – | 26.223.262 | – | 26.223.262 |
| Schatzwechsel | – | 39.453.874 | – | 39.453.874 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 1.519.496 | – | 1.519.496 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten | – | 0 | – | 0 |
| Vermögenswerte insgesamt | – | 77.727.468 | – | 77.727.468 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (333.046) | – | (333.046) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (333.046) | – | (333.046) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Corporate Hybrid Bond

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 EUR | Stufe 2 EUR | Stufe 3 EUR | Insgesamt EUR |
|---|----------------|----------------------|----------------|----------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Unternehmensanleihen | – | 1.743.583.625 | – | 1.743.583.625 |
| Investmentfonds | – | 10.956.412 | – | 10.956.412 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 12.101.176 | – | 12.101.176 |
| Vermögenswerte insgesamt | – | 1.766.641.213 | – | 1.766.641.213 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 EUR | Stufe 2 EUR | Stufe 3 EUR | Insgesamt EUR |
|--|----------------|--------------------|----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (7.732.130) | – | (7.732.130) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (7.732.130) | – | (7.732.130) |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 EUR | Stufe 2 EUR | Stufe 3 EUR | Insgesamt EUR |
|---|----------------|----------------------|----------------|----------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Unternehmensanleihen | – | 1.638.001.345 | – | 1.638.001.345 |
| Investmentfonds | – | 10.317.170 | – | 10.317.170 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 36.511.573 | – | 36.511.573 |
| Vermögenswerte insgesamt | – | 1.684.830.088 | – | 1.684.830.088 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 EUR | Stufe 2 EUR | Stufe 3 EUR | Insgesamt EUR |
|--|----------------|---------------------|----------------|---------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | – | (37.445.575) | – | (37.445.575) |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (20.223.334) | – | (20.223.334) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (57.668.909) | – | (57.668.909) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Developed Market FMP – 2027¹

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Unternehmensanleihen | – | 135.777.186 | – | 135.777.186 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 39.869 | – | 39.869 |
| Vermögenswerte insgesamt | – | 135.817.055 | – | 135.817.055 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (393) | – | (393) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (393) | – | (393) |

Emerging Market Debt - Hard Currency

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-------------------|----------------------|-----------------|----------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Unternehmensanleihen | – | 732.442.764 | – | 732.442.764 |
| Staatsanleihen | – | 1.794.182.602 | – | 1.794.182.602 |
| Investmentfonds | – | 17.580.000 | – | 17.580.000 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 24.839.124 | – | 24.839.124 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 19.568.314 | – | – | 19.568.314 |
| Vermögenswerte insgesamt | 19.568.314 | 2.569.044.490 | – | 2.588.612.804 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|---------------------|--------------------|-----------------|---------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (5.652.118) | – | (5.652.118) |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (10.222.785) | – | – | (10.222.785) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | (10.222.785) | (5.652.118) | – | (15.874.903) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-------------------|----------------------|-----------------|----------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Unternehmensanleihen | – | 784.977.470 | – | 784.977.470 |
| Staatsanleihen | – | 1.508.020.941 | – | 1.508.020.941 |
| Investmentfonds | – | 16.110.000 | – | 16.110.000 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 12.379.899 | – | 12.379.899 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 23.148.647 | – | – | 23.148.647 |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | – | 1.909.636 | – | 1.909.636 |
| Vermögenswerte insgesamt | 23.148.647 | 2.323.397.946 | – | 2.346.546.593 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|--------------------|---------------------|-----------------|---------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (10.560.096) | – | (10.560.096) |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (1.308.787) | – | – | (1.308.787) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | (1.308.787) | (10.560.096) | – | (11.868.883) |

Emerging Market Debt - Local Currency

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------|----------------------|-----------------|----------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Schatzwechsel | – | 33.341.150 | – | 33.341.150 |
| Unternehmensanleihen | – | 41.825.600 | – | 41.825.600 |
| Staatsanleihen | – | 1.124.421.834 | – | 1.124.421.834 |
| Investmentfonds | – | 16.173.300 | – | 16.173.300 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 17.116.276 | – | 17.116.276 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 313.668 | – | – | 313.668 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten | – | 11.479.756 | – | 11.479.756 |
| Vermögenswerte insgesamt | 313.668 | 1.244.357.916 | – | 1.244.671.584 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|------------------|---------------------|-----------------|---------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (12.281.584) | – | (12.281.584) |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (716.676) | – | – | (716.676) |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten | – | (14.977.755) | – | (14.977.755) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | (716.676) | (27.259.339) | – | (27.976.015) |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------|----------------------|-----------------|----------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Einlagenzertifikat | – | 18.492.177 | – | 18.492.177 |
| Unternehmensanleihen | – | 22.468.723 | – | 22.468.723 |
| Staatsanleihen | – | 1.280.353.016 | – | 1.280.353.016 |
| Investmentfonds | – | 15.136.550 | – | 15.136.550 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 14.987.459 | – | 14.987.459 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten | – | 8.845.584 | – | 8.845.584 |
| Vermögenswerte insgesamt | – | 1.360.283.509 | – | 1.360.283.509 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|------------------|---------------------|-----------------|---------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (9.665.447) | – | (9.665.447) |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (676.393) | – | – | (676.393) |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten | – | (47.106.454) | – | (47.106.454) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | (676.393) | (56.771.901) | – | (57.448.294) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Emerging Market Debt Blend

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Schatzwechsel | – | 1.006.392 | – | 1.006.392 |
| Unternehmensanleihen | – | 148.077.852 | – | 148.077.852 |
| Staatsanleihen | – | 330.568.106 | – | 330.568.106 |
| Investmentfonds | – | 14.297.035 | – | 14.297.035 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 6.637.946 | – | 6.637.946 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 1.199.361 | – | – | 1.199.361 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten | – | 2.641.912 | – | 2.641.912 |
| Vermögenswerte insgesamt | 1.199.361 | 503.229.243 | – | 504.428.604 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (2.075.226) | – | (2.075.226) |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (969.525) | – | – | (969.525) |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten | – | (5.804.925) | – | (5.804.925) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | (969.525) | (7.880.151) | – | (8.849.676) |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Unternehmensanleihen | – | 149.902.253 | – | 149.902.253 |
| Staatsanleihen | – | 288.112.593 | – | 288.112.593 |
| Investmentfonds | – | 13.380.558 | – | 13.380.558 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 4.031.358 | – | 4.031.358 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 1.175.800 | – | – | 1.175.800 |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | – | 1.658.685 | – | 1.658.685 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten | – | 4.841.085 | – | 4.841.085 |
| Vermögenswerte insgesamt | 1.175.800 | 461.926.532 | – | 463.102.332 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|------------------|---------------------|-----------------|---------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (2.058.976) | – | (2.058.976) |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (159.705) | – | – | (159.705) |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten | – | (11.561.405) | – | (11.561.405) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | (159.705) | (13.620.381) | – | (13.780.086) |

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Schatzwechsel | – | 821.151 | – | 821.151 |
| Unternehmensanleihen | – | 9.239.606 | – | 9.239.606 |
| Staatsanleihen | – | 48.266.565 | – | 48.266.565 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 2.325.031 | – | 2.325.031 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 832.110 | – | – | 832.110 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten | – | 19.138 | – | 19.138 |
| Vermögenswerte insgesamt | 832.110 | 60.671.491 | – | 61.503.601 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|------------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (284.238) | – | (284.238) |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (356.901) | – | – | (356.901) |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten | – | (38.443) | – | (38.443) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | (356.901) | (322.681) | – | (679.582) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Unternehmensanleihen | – | 7.512.041 | – | 7.512.041 |
| Staatsanleihen | – | 42.285.874 | – | 42.285.874 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 446.879 | – | 446.879 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 610.127 | – | – | 610.127 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten | – | 43.385 | – | 43.385 |
| Vermögenswerte insgesamt | 610.127 | 50.288.179 | – | 50.898.306 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (340.697) | – | (340.697) |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (65.989) | – | – | (65.989) |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten | – | (135.722) | – | (135.722) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | (65.989) | (476.419) | – | (542.408) |

Emerging Markets Equity

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-------------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | 67.541.404 | 19.761.296 | – | 87.302.700 |
| Immobilienaktiengesellschaften | 481.105 | – | – | 481.105 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 1.272.409 | – | 1.272.409 |
| Vermögenswerte insgesamt | 68.022.509 | 21.033.705 | – | 89.056.214 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (787.152) | – | (787.152) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (787.152) | – | (787.152) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|
| Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 1 | | | |
| Aktien | 2.701.849 | (2.701.849) | – |

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden bestimmte Aktien von Stufe 2 in Stufe 1 übertragen, da die Preisfindung durch einen Pricing-Anbieter erfolgte.

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|--------------------|-------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | 139.636.822 | 49.097.184 | – | 188.734.006 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 1.053.813 | – | 1.053.813 |
| Vermögenswerte insgesamt | 139.636.822 | 50.150.997 | – | 189.787.819 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (666.859) | – | (666.859) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (666.859) | – | (666.859) |

Emerging Markets Select Equity*

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-------------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | 67.247.423 | 23.179.556 | – | 90.426.979 |
| Insgesamt | 67.247.423 | 23.179.556 | – | 90.426.979 |

* Das Portfolio wurde am 7. September 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Euro Bond

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 EUR | Stufe 2 EUR | Stufe 3 EUR | Insgesamt EUR |
|---|----------------|-------------------|----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | – | 4.100 | – | 4.100 |
| Unternehmensanleihen | – | 4.770.071 | – | 4.770.071 |
| Staatsanleihen | – | 5.399.389 | – | 5.399.389 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 32.300 | – | – | 32.300 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten | – | 6.642 | – | 6.642 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten | – | 7.001 | – | 7.001 |
| Vermögenswerte insgesamt | 32.300 | 10.187.203 | – | 10.219.503 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 EUR | Stufe 2 EUR | Stufe 3 EUR | Insgesamt EUR |
|---|-----------------|-----------------|----------------|------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (19.007) | – | – | (19.007) |
| Nicht realisierter Verlust aus Inflation-Swap-Kontrakten | – | (3.665) | – | (3.665) |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten | – | (3.982) | – | (3.982) |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | – | (54.486) | – | (54.486) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | (19.007) | (62.133) | – | (81.140) |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 EUR | Stufe 2 EUR | Stufe 3 EUR | Insgesamt EUR |
|---|----------------|------------------|----------------|------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | – | 462.816 | – | 462.816 |
| Unternehmensanleihen | – | 4.079.176 | – | 4.079.176 |
| Staatsanleihen | – | 4.005.023 | – | 4.005.023 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten | – | 93 | – | 93 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 41.432 | – | – | 41.432 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten | – | 1.858 | – | 1.858 |
| Vermögenswerte insgesamt | 41.432 | 8.548.966 | – | 8.590.398 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Euro Bond (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 EUR | Stufe 2 EUR | Stufe 3 EUR | Insgesamt EUR |
|---|-----------------|-----------------|----------------|------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (82.010) | – | – | (82.010) |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | – | (6.528) | – | (6.528) |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten | – | (23.909) | – | (23.909) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | (82.010) | (30.437) | – | (112.447) |

Euro Bond Absolute Return

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 EUR | Stufe 2 EUR | Stufe 3 EUR | Insgesamt EUR |
|---|----------------|-------------------|----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | – | 158.727 | – | 158.727 |
| Unternehmensanleihen | – | 18.558.164 | – | 18.558.164 |
| Staatsanleihen | – | 14.456.150 | – | 14.456.150 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 25.383 | – | 25.383 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 47.035 | – | – | 47.035 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten | – | 26.569 | – | 26.569 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten | – | 113.881 | – | 113.881 |
| Vermögenswerte insgesamt | 47.035 | 33.338.874 | – | 33.385.909 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 EUR | Stufe 2 EUR | Stufe 3 EUR | Insgesamt EUR |
|---|------------------|--------------------|----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (1.117.757) | – | (1.117.757) |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (301.831) | – | – | (301.831) |
| Nicht realisierter Verlust aus Inflation-Swap-Kontrakten | – | (14.661) | – | (14.661) |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | – | (181.087) | – | (181.087) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | (301.831) | (1.313.505) | – | (1.615.336) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Euro Bond Absolute Return (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 EUR | Stufe 2 EUR | Stufe 3 EUR | Insgesamt EUR |
|---|------------------|-------------------|----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | – | 2.319.216 | – | 2.319.216 |
| Unternehmensanleihen | – | 23.938.251 | – | 23.938.251 |
| Staatsanleihen | – | 19.650.553 | – | 19.650.553 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten | – | 61.989 | – | 61.989 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 39.745 | – | 39.745 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 1.497.736 | – | – | 1.497.736 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten | – | 12.884 | – | 12.884 |
| Vermögenswerte insgesamt | 1.497.736 | 46.022.638 | – | 47.520.374 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 EUR | Stufe 2 EUR | Stufe 3 EUR | Insgesamt EUR |
|---|------------------|--------------------|----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Inflation-Swap-Kontrakten | – | (67.569) | – | (67.569) |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (1.032.074) | – | (1.032.074) |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (103.516) | – | – | (103.516) |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | – | (32.637) | – | (32.637) |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten | – | (43.820) | – | (43.820) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | (103.516) | (1.176.100) | – | (1.279.616) |

European High Yield Bond

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 EUR | Stufe 2 EUR | Stufe 3 EUR | Insgesamt EUR |
|--|----------------|--------------------|----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | – | 2.425.341 | – | 2.425.341 |
| Unternehmensanleihen | – | 384.433.736 | – | 384.433.736 |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen | – | 114.727 | – | 114.727 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 643.091 | – | 643.091 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten | – | 18.355 | – | 18.355 |
| Vermögenswerte insgesamt | – | 387.635.250 | – | 387.635.250 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

European High Yield Bond (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 EUR | Stufe 2 EUR | Stufe 3 EUR | Insgesamt EUR |
|--|----------------|--------------------|----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (1.281.452) | – | (1.281.452) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (1.281.452) | – | (1.281.452) |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 EUR | Stufe 2 EUR | Stufe 3 EUR | Insgesamt EUR |
|---|----------------|-------------------|----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | – | 215.121 | – | 215.121 |
| Unternehmensanleihen | – | 32.065.000 | – | 32.065.000 |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen | – | 202.519 | – | 202.519 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 1.258.544 | – | 1.258.544 |
| Vermögenswerte insgesamt | – | 33.741.184 | – | 33.741.184 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 EUR | Stufe 2 EUR | Stufe 3 EUR | Insgesamt EUR |
|--|----------------|--------------------|----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (3.113.019) | – | (3.113.019) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (3.113.019) | – | (3.113.019) |

European Sustainable Equity

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 EUR | Stufe 2 EUR | Stufe 3 EUR | Insgesamt EUR |
|---|--------------------|----------------|----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | 171.225.790 | – | – | 171.225.790 |
| Vermögenswerte insgesamt | 171.225.790 | – | – | 171.225.790 |

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|
| Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 1 | | | |
| Aktien | 111.860.905 | (111.860.905) | – |

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden bestimmte Aktien von Stufe 2 in Stufe 1 übertragen, da die Preisfindung durch einen Pricing-Anbieter erfolgte.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

European Sustainable Equity (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 EUR | Stufe 2 EUR | Stufe 3 EUR | Insgesamt EUR |
|---|-------------------|--------------------|----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | 40.367.498 | 134.021.329 | – | 174.388.827 |
| Vermögenswerte insgesamt | 40.367.498 | 134.021.329 | – | 174.388.827 |

Event Driven²

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Schatzwechsel | – | 115.039.719 | – | 115.039.719 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 4.057.943 | – | 4.057.943 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten | – | 959.529 | – | 959.529 |
| Vermögenswerte insgesamt | – | 120.057.191 | – | 120.057.191 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (155.365) | – | (155.365) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (155.365) | – | (155.365) |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Schatzwechsel | – | 33.823.354 | – | 33.823.354 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 918.069 | – | 918.069 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten | – | 18.364 | – | 18.364 |
| Vermögenswerte insgesamt | – | 34.759.787 | – | 34.759.787 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Event Driven² (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (18.616) | – | (18.616) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (18.616) | – | (18.616) |

Global Bond

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Agency Bonds | – | 1.146.538 | – | 1.146.538 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | – | 10.864.506 | – | 10.864.506 |
| Unternehmensanleihen | – | 28.855.602 | – | 28.855.602 |
| Staatsanleihen | – | 42.481.574 | – | 42.481.574 |
| Mortgage-Backed Securities | – | 22.645.649 | – | 22.645.649 |
| Kommunalanleihen | – | 1.278.776 | – | 1.278.776 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 3.337.129 | – | 3.337.129 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 440.690 | – | – | 440.690 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten | – | 124.708 | – | 124.708 |
| Vermögenswerte insgesamt | 440.690 | 110.734.482 | – | 111.175.172 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (3.195.228) | – | (3.195.228) |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (622.972) | – | – | (622.972) |
| Nicht realisierter Verlust aus Credit Default Swap-Kontrakten | – | (72.291) | – | (72.291) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | (622.972) | (3.267.519) | – | (3.890.491) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Global Bond (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Agency Bonds | – | 2.423.190 | – | 2.423.190 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | – | 8.861.707 | – | 8.861.707 |
| Unternehmensanleihen | – | 44.359.194 | – | 44.359.194 |
| Staatsanleihen | – | 53.670.009 | – | 53.670.009 |
| Mortgage-Backed Securities | – | 19.062.981 | – | 19.062.981 |
| Kommunalanleihen | – | 1.706.806 | – | 1.706.806 |
| Schatzwechsel | – | 791.814 | – | 791.814 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 2.638.428 | – | 2.638.428 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 270.257 | – | – | 270.257 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten | – | 1.233 | – | 1.233 |
| Vermögenswerte insgesamt | 270.257 | 133.515.362 | – | 133.785.619 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (1.908.377) | – | (1.908.377) |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (191.230) | – | – | (191.230) |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | – | (13.185) | – | (13.185) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | (191.230) | (1.921.562) | – | (2.112.792) |

Global Diversified Income FMP – 2024

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Schatzwechsel | – | 18.765.889 | – | 18.765.889 |
| Unternehmensanleihen | – | 123.463.985 | – | 123.463.985 |
| Staatsanleihen | – | 1.727.993 | – | 1.727.993 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 281.732 | – | 281.732 |
| Vermögenswerte insgesamt | – | 144.239.599 | – | 144.239.599 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Global Diversified Income FMP – 2024 (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Unternehmensanleihen | – | 150.336.737 | – | 150.336.737 |
| Staatsanleihen | – | 3.931.136 | – | 3.931.136 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 523.987 | – | 523.987 |
| Vermögenswerte insgesamt | – | 154.791.860 | – | 154.791.860 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (417) | – | (417) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (417) | – | (417) |

Global Equity Megatrends

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|--------------------|-----------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | 141.492.601 | – | – | 141.492.601 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 444 | – | 444 |
| Vermögenswerte insgesamt | 141.492.601 | 444 | – | 141.493.045 |

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ |
|--|-----------------|-----------------|-----------------|
|--|-----------------|-----------------|-----------------|

Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 1

| | | | |
|--------|-----------|-------------|---|
| Aktien | 7.576.699 | (7.576.699) | – |
|--------|-----------|-------------|---|

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurde eine Aktie von Stufe 2 in Stufe 1 übertragen, da die Preisfindung durch einen Pricing-Anbieter erfolgte.

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-------------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | 75.013.478 | 4.451.857 | – | 79.465.335 |
| Vermögenswerte insgesamt | 75.013.478 | 4.451.857 | – | 79.465.335 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Global Flexible Credit Income

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3* US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|------------------|--------------------|------------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | – | – | 6.022.083 | 6.022.083 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | – | 23.118.219 | – | 23.118.219 |
| Unternehmensanleihen | – | 295.514.545 | 758.917 | 296.273.462 |
| Staatsanleihen | – | 15.379.748 | – | 15.379.748 |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen | – | 14.359.621 | 746.253 | 15.105.874 |
| Investmentfonds | 66.832 | – | – | 66.832 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 8.130.820 | – | 8.130.820 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 3.733.739 | – | – | 3.733.739 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten | – | 268.263 | – | 268.263 |
| Vermögenswerte insgesamt | 3.800.571 | 356.771.216 | 7.527.253 | 368.099.040 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3* US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|--------------------|--------------------|------------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (3.447.658) | – | (3.447.658) |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (5.173.223) | – | – | (5.173.223) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | (5.173.223) | (3.447.658) | – | (8.620.881) |

* Eine Aktie und Unternehmensanleihen der Stufe 3 wurden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren bewertet. Eine mittelfristige Schuldverschreibung der Stufe 3 wurde basierend auf einer von einem Händler verfügbaren Einzelnotierung bewertet. Das Portfolio hat keinen Zugang zu nicht beobachtbaren Parametern und kann daher derartige Parameter, die bei der Erstellung dieser Gleichung eingesetzt werden, nicht offenlegen.

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|
| Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 3 | | | |
| Unternehmensanleihe | – | (247.792) | 247.792 |

Zum Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurde eine Unternehmensanleihe von Stufe 2 in Stufe 3 übertragen, da von den Direktoren genehmigten Preisfindungsverfahren verwendet werden.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Global Flexible Credit Income (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------|--------------------|------------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | – | 24.079.041 | – | 24.079.041 |
| Unternehmensanleihen | – | 316.164.124 | – | 316.164.124 |
| Aktien | – | – | 5.247.334 | 5.247.334 |
| Staatsanleihen | – | 9.817.787 | – | 9.817.787 |
| Investmentfonds | 338.564 | – | – | 338.564 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 29.033.515 | – | 29.033.515 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 468.202 | – | – | 468.202 |
| Vermögenswerte insgesamt | 806.766 | 379.094.467 | 5.247.334 | 385.148.567 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|------------------|---------------------|-----------------|---------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (10.857.921) | – | (10.857.921) |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (515.955) | – | – | (515.955) |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten | – | (632.100) | – | (632.100) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | (515.955) | (11.490.021) | – | (12.005.976) |

Global High Yield SDG Engagement

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3* US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------|--------------------|------------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Unternehmensanleihen | – | 530.465.171 | 2.034.310 | 532.499.481 |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen | – | 4.933 | – | 4.933 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 11.935.674 | – | 11.935.674 |
| Vermögenswerte insgesamt | – | 542.405.778 | 2.034.310 | 544.440.088 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3* US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|--------------------|------------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (6.738.234) | – | (6.738.234) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (6.738.234) | – | (6.738.234) |

* Unternehmensanleihen der Stufe 3 wurden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren bewertet.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Global High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|
| Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 3 | | | |
| Unternehmensanleihen | – | (1.136.259) | 1.136.259 |
| Übertragungen von Stufe 3 in Stufe 2 | | | |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen | – | 4.933 | (4.933) |

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden bestimmte Unternehmensanleihen von Stufe 2 in Stufe 3 übertragen, da von den Direktoren genehmigten Preisfindungsverfahren verwendet werden.

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden mittelfristige Schuldverschreibungen von Stufe 3 in Stufe 2 übertragen, da diese die von den Direktoren genehmigten Bewertungsverfahren nicht mehr verwenden.

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Unternehmensanleihen | – | 273.005.334 | – | 273.005.334 |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen | – | 687.601 | 325.875 | 1.013.476 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 12.873.530 | – | 12.873.530 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten | – | 13.411 | – | 13.411 |
| Vermögenswerte insgesamt | – | 286.579.876 | 325.875 | 286.905.751 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (9.426.254) | – | (9.426.254) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (9.426.254) | – | (9.426.254) |

Global High Yield Sustainable Action*

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Unternehmensanleihen | – | 14.443.671 | – | 14.443.671 |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen | – | 95.881 | – | 95.881 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 7.620 | – | 7.620 |
| Vermögenswerte insgesamt | – | 14.547.172 | – | 14.547.172 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Global High Yield Sustainable Action* (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (358.029) | – | (358.029) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (358.029) | – | (358.029) |

* Das Portfolio wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

Global Investment Grade Credit

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Unternehmensanleihen | – | 81.376.321 | – | 81.376.321 |
| Staatsanleihen | – | 2.082.454 | – | 2.082.454 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 1.115 | – | 1.115 |
| Vermögenswerte insgesamt | – | 83.459.890 | – | 83.459.890 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (1.107.450) | – | (1.107.450) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (1.107.450) | – | (1.107.450) |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Unternehmensanleihen | – | 80.767.363 | – | 80.767.363 |
| Staatsanleihen | – | 2.758.010 | – | 2.758.010 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 16.124 | – | 16.124 |
| Vermögenswerte insgesamt | – | 83.541.497 | – | 83.541.497 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Global Investment Grade Credit (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (1.642.819) | – | (1.642.819) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (1.642.819) | – | (1.642.819) |

Global Opportunistic Bond

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | – | 1.817.743 | – | 1.817.743 |
| Unternehmensanleihen | – | 27.412.055 | – | 27.412.055 |
| Staatsanleihen | – | 21.133.383 | – | 21.133.383 |
| Mortgage-Backed Securities | – | 14.565.802 | – | 14.565.802 |
| Investmentfonds | 21.165 | – | – | 21.165 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 4.673.609 | – | 4.673.609 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 839.044 | – | – | 839.044 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten | – | 76 | – | 76 |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | – | 193.716 | – | 193.716 |
| Vermögenswerte insgesamt | 860.209 | 69.796.384 | – | 70.656.593 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (6.577.836) | – | (6.577.836) |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (356.573) | – | – | (356.573) |
| Nicht realisierter Verlust aus Credit Default Swap-Kontrakten | – | (821.571) | – | (821.571) |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten | – | (27) | – | (27) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | (356.573) | (7.399.434) | – | (7.756.007) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Global Opportunistic Bond (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Agency Bonds | – | 307.820 | – | 307.820 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | – | 4.290.102 | – | 4.290.102 |
| Unternehmensanleihen | – | 35.431.699 | – | 35.431.699 |
| Staatsanleihen | – | 24.711.043 | – | 24.711.043 |
| Investmentfonds | 107.216 | 1.694.000 | – | 1.801.216 |
| Mortgage-Backed Securities | – | 10.458.233 | – | 10.458.233 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 2.069.747 | – | 2.069.747 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 568.616 | – | – | 568.616 |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | – | 455.060 | – | 455.060 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten | – | 17.416 | – | 17.416 |
| Vermögenswerte insgesamt | 675.832 | 79.435.120 | – | 80.110.952 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (4.857.533) | – | (4.857.533) |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (607.164) | – | – | (607.164) |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | – | (64.729) | – | (64.729) |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten | – | (141) | – | (141) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | (607.164) | (4.922.403) | – | (5.529.567) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Global Real Estate Securities

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-------------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | 3.015.990 | – | – | 3.015.990 |
| Immobilienaktiengesellschaften | 17.071.668 | – | – | 17.071.668 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 422.478 | – | 422.478 |
| Vermögenswerte insgesamt | 20.087.658 | 422.478 | – | 20.510.136 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (250.684) | – | (250.684) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (250.684) | – | (250.684) |

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|
| Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 1 | | | |
| Aktien | 157.095 | (157.095) | – |
| Immobilienaktiengesellschaften | 1.198.728 | (1.198.728) | – |

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden eine Aktie und eine Immobilienaktiengesellschaft von Stufe 2 in Stufe 1 übertragen, da die Preisfindung durch einen Pricing-Anbieter erfolgte.

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-------------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | 5.878.530 | 967.525 | – | 6.846.055 |
| Immobilienaktiengesellschaften | 26.313.894 | 4.046.904 | – | 30.360.798 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 866.015 | – | 866.015 |
| Vermögenswerte insgesamt | 32.192.424 | 5.880.444 | – | 38.072.868 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (147.763) | – | (147.763) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (147.763) | – | (147.763) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Global Real Estate Securities (Fortsetzung)

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|
| Übertragungen von Stufe 3 in Stufe 1 | | | |
| Immobilienaktiengesellschaften | 404.924 | – | (404.924) |

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 wurden Immobilienaktiengesellschaften von Stufe 3 in Stufe 1 übertragen, da die Immobilienaktiengesellschaften die von den Direktoren genehmigten Bewertungsverfahren nicht mehr verwenden.

Global Sustainable Equity

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|--------------------|-----------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | 153.603.419 | – | – | 153.603.419 |
| Vermögenswerte insgesamt | 153.603.419 | – | – | 153.603.419 |

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|
| Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 1 | | | |
| Aktien | 34.643.299 | (34.643.299) | – |

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden bestimmte Aktien von Stufe 2 in Stufe 1 übertragen, da die Preisfindung durch einen Pricing-Anbieter erfolgte.

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-------------------|-------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | 96.654.246 | 33.870.236 | – | 130.524.482 |
| Vermögenswerte insgesamt | 96.654.246 | 33.870.236 | – | 130.524.482 |

Global Sustainable Value

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-------------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | 52.447.814 | 1.361.257 | – | 53.809.071 |
| Immobilienaktiengesellschaften | 1.116.404 | – | – | 1.116.404 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 66.448 | – | 66.448 |
| Vermögenswerte insgesamt | 53.564.218 | 1.427.705 | – | 54.991.923 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Global Sustainable Value (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (46.897) | – | (46.897) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (46.897) | – | (46.897) |
| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | |
| Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 1 | | | | |
| Aktien | 5.120.024 | (5.120.024) | – | |
| Immobilienaktiengesellschaften | 87.109 | (87.109) | – | |

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden bestimmte Aktien und eine Immobilienaktiengesellschaft von Stufe 2 in Stufe 1 übertragen, da die Preisfindung durch einen Pricing-Anbieter erfolgte.

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-------------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | 37.427.578 | 9.532.811 | – | 46.960.389 |
| Immobilienaktiengesellschaften | 545.905 | 209.532 | – | 755.437 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 125.312 | – | 125.312 |
| Vermögenswerte insgesamt | 37.973.483 | 9.867.655 | – | 47.841.138 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (90.456) | – | (90.456) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (90.456) | – | (90.456) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

High Yield Bond

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3* US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|------------------|----------------------|-------------------|----------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | – | 10.897.982 | – | 10.897.982 |
| Unternehmensanleihen | – | 1.984.515.926 | 14.661.425 | 1.999.177.351 |
| Staatsanleihen | – | 36.225.768 | – | 36.225.768 |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen | – | 43.084.058 | – | 43.084.058 |
| Investmentfonds | 3.611.285 | – | – | 3.611.285 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 40.709.223 | – | 40.709.223 |
| Vermögenswerte insgesamt | 3.611.285 | 2.115.432.957 | 14.661.425 | 2.133.705.667 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3* US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|---------------------|------------------|---------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (15.391.406) | – | (15.391.406) |
| Nicht realisierter Verlust aus Return--Swap-Kontrakten | – | (51.928) | – | (51.928) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (15.443.334) | – | (15.443.334) |

* Unternehmensanleihen der Stufe 3 wurden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren bewertet.

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|
| Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 3 | | | |
| Unternehmensanleihen | – | (7.195.550) | 7.195.550 |
| Übertragungen von Stufe 3 in Stufe 2 | | | |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen | – | 4.940 | (4.940) |

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden bestimmte Unternehmensanleihen von Stufe 2 in Stufe 3 übertragen, da von den Direktoren genehmigten Preisfindungsverfahren verwendet werden.

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurde ein Laufzeitkredit von Stufe 3 in Stufe 2 übertragen, da die für die Bewertung verfügbaren Dealerquotierungen gestiegen sind.

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-------------------|----------------------|------------------|----------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | – | 21.830.306 | – | 21.830.306 |
| Unternehmensanleihen | – | 1.982.553.426 | – | 1.982.553.426 |
| Investmentfonds | 18.294.706 | – | – | 18.294.706 |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen | – | 85.843.814 | 5.791.687 | 91.635.501 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 55.707.544 | – | 55.707.544 |
| Vermögenswerte insgesamt | 18.294.706 | 2.145.935.090 | 5.791.687 | 2.170.021.483 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

High Yield Bond (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------|---------------------|-----------------|---------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (25.192.706) | – | (25.192.706) |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten | – | (404.963) | – | (404.963) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (25.597.669) | – | (25.597.669) |
| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | |
| Übertragungen von Stufe 3 in Stufe 2 | | | | |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen | – | 13.907.802 | (13.907.802) | |

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 wurde ein Laufzeitkredit von Stufe 3 in Stufe 2 übertragen, da die für die Bewertung verfügbaren Dealerquotierungen gestiegen sind.

InnovAsia 5G

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-------------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | 22.524.887 | – | – | 22.524.887 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 299.135 | – | 299.135 |
| Vermögenswerte insgesamt | 22.524.887 | 299.135 | – | 22.824.022 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (60.136) | – | (60.136) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (60.136) | – | (60.136) |
| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | |
| Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 1 | | | | |
| Aktien | 1.003.652 | (1.003.652) | – | |

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurde eine Aktie von Stufe 2 in Stufe 1 übertragen, da die Preisfindung durch einen Pricing-Anbieter erfolgte.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

InnovAsia 5G (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-------------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | 13.493.208 | 379.300 | – | 13.872.508 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 453.339 | – | 453.339 |
| Vermögenswerte insgesamt | 13.493.208 | 832.639 | – | 14.325.847 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (78.732) | – | (78.732) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (78.732) | – | (78.732) |

Japan Equity Engagement

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 JPY | Stufe 2 JPY | Stufe 3 JPY | Insgesamt JPY |
|---|-----------------------|--------------------|----------------|-----------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | 15.961.893.000 | – | – | 15.961.893.000 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 128.484.079 | – | 128.484.079 |
| Vermögenswerte insgesamt | 15.961.893.000 | 128.484.079 | – | 16.090.377.079 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 JPY | Stufe 2 JPY | Stufe 3 JPY | Insgesamt JPY |
|--|----------------|---------------------|----------------|---------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (42.002.252) | – | (42.002.252) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (42.002.252) | – | (42.002.252) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Japan Equity Engagement (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 JPY | Stufe 2 JPY | Stufe 3 JPY | Insgesamt JPY |
|---|-----------------------|-------------------|----------------|-----------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | 20.207.455.300 | – | – | 20.207.455.300 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 44.531.344 | – | 44.531.344 |
| Vermögenswerte insgesamt | 20.207.455.300 | 44.531.344 | – | 20.251.986.644 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 JPY | Stufe 2 JPY | Stufe 3 JPY | Insgesamt JPY |
|--|----------------|----------------------|----------------|----------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (141.215.249) | – | (141.215.249) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (141.215.249) | – | (141.215.249) |

Macro Opportunities FX

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 EUR | Stufe 2 EUR | Stufe 3 EUR | Insgesamt EUR |
|---|----------------|------------------|----------------|------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Schatzwechsel | – | 2.407.376 | – | 2.407.376 |
| Staatsanleihen | – | 347.166 | – | 347.166 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 4.627.295 | – | 4.627.295 |
| Vermögenswerte insgesamt | – | 7.381.837 | – | 7.381.837 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 EUR | Stufe 2 EUR | Stufe 3 EUR | Insgesamt EUR |
|--|----------------|--------------------|----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (4.613.695) | – | (4.613.695) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (4.613.695) | – | (4.613.695) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Macro Opportunities FX (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 EUR | Stufe 2 EUR | Stufe 3 EUR | Insgesamt EUR |
|---|----------------|-------------------|----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Unternehmensanleihen | – | 24.967.521 | – | 24.967.521 |
| Staatsanleihen | – | 2.778.639 | – | 2.778.639 |
| Schatzwechsel | – | 4.389.983 | – | 4.389.983 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 3.617.207 | – | 3.617.207 |
| Vermögenswerte insgesamt | – | 35.753.350 | – | 35.753.350 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 EUR | Stufe 2 EUR | Stufe 3 EUR | Insgesamt EUR |
|--|----------------|--------------------|----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (4.428.576) | – | (4.428.576) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (4.428.576) | – | (4.428.576) |

Multi-Asset Income*

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|------------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Agency Bonds | – | 7.644 | – | 7.644 |
| Unternehmensanleihen | – | 4.880.908 | – | 4.880.908 |
| Aktien | 2.520.628 | 327.820 | – | 2.848.448 |
| Staatsanleihen | – | 311.601 | – | 311.601 |
| Investmentfonds | 29.623 | 572.562 | – | 602.185 |
| Gekaufte Optionskontrakte | 4.207 | – | – | 4.207 |
| Immobilienaktiengesellschaften | 364.808 | – | – | 364.808 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 160.435 | – | 160.435 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 51.032 | – | – | 51.032 |
| Vermögenswerte insgesamt | 2.970.298 | 6.260.970 | – | 9.231.268 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Multi-Asset Income* (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Verkaufte Optionskontrakte | (59.717) | – | – | (59.717) |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (584.335) | – | (584.335) |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (2.994) | – | – | (2.994) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | (62.711) | (584.335) | – | (647.046) |

* Das Portfolio wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

Next Generation Mobility

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|--------------------|------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | 149.804.841 | 1.389.795 | – | 151.194.636 |
| Immobilienaktiengesellschaften | 1.619.728 | – | – | 1.619.728 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 20.789 | – | 20.789 |
| Vermögenswerte insgesamt | 151.424.569 | 1.410.584 | – | 152.835.153 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (10.365) | – | (10.365) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (10.365) | – | (10.365) |

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|
| Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 1 | | | |
| Aktien | 10.502.393 | (10.502.393) | – |

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden bestimmte Aktien von Stufe 2 in Stufe 1 übertragen, da die Preisfindung durch einen Pricing-Anbieter erfolgte.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Next Generation Mobility (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|--------------------|------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | 129.334.927 | 7.542.858 | – | 136.877.785 |
| Immobilienaktiengesellschaften | 1.522.531 | – | – | 1.522.531 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 294.328 | – | 294.328 |
| Vermögenswerte insgesamt | 130.857.458 | 7.837.186 | – | 138.694.644 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (213.661) | – | (213.661) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (213.661) | – | (213.661) |

Next Generation Space Economy²

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-------------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | 17.658.423 | 1.016.293 | – | 18.674.716 |
| Vermögenswerte insgesamt | 17.658.423 | 1.016.293 | – | 18.674.716 |

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|
| Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 1 | | | |
| Aktien | 2.205.585 | (2.205.585) | – |

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden bestimmte Aktien von Stufe 2 in Stufe 1 übertragen, da die Preisfindung durch einen Pricing-Anbieter erfolgte.

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|------------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | 6.156.111 | 1.825.563 | – | 7.981.674 |
| Vermögenswerte insgesamt | 6.156.111 | 1.825.563 | – | 7.981.674 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Responsible Asian Debt - Hard Currency

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Schatzwechsel | – | 2.496.736 | – | 2.496.736 |
| Unternehmensanleihen | – | 45.692.223 | – | 45.692.223 |
| Staatsanleihen | – | 12.025.196 | – | 12.025.196 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 127.055 | – | 127.055 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 255.858 | – | – | 255.858 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten | – | 575 | – | 575 |
| Vermögenswerte insgesamt | 255.858 | 60.341.785 | – | 60.597.643 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|------------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (135.330) | – | (135.330) |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (128.113) | – | – | (128.113) |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten | – | (21) | – | (21) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | (128.113) | (135.351) | – | (263.464) |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Unternehmensanleihen | – | 18.090.069 | – | 18.090.069 |
| Staatsanleihen | – | 2.090.986 | – | 2.090.986 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 34.382 | – | 34.382 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 47.079 | – | – | 47.079 |
| Vermögenswerte insgesamt | 47.079 | 20.215.437 | – | 20.262.516 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (84.733) | – | (84.733) |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (3.440) | – | – | (3.440) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | (3.440) | (84.733) | – | (88.173) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Short Duration Emerging Market Debt

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3* US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------|----------------------|------------------|----------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Schatzwechsel | – | 53.894.704 | – | 53.894.704 |
| Unternehmensanleihen | – | 2.405.987.373 | 500.000 | 2.406.487.373 |
| Staatsanleihen | – | 1.307.631.941 | – | 1.307.631.941 |
| Investmentfonds | – | 49.810.000 | – | 49.810.000 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 64.552.046 | – | 64.552.046 |
| Vermögenswerte insgesamt | – | 3.881.876.064 | 500.000 | 3.882.376.064 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3* US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|--------------------|------------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (9.131.675) | – | (9.131.675) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (9.131.675) | – | (9.131.675) |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3* US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------|----------------------|------------------|----------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Unternehmensanleihen | – | 3.527.185.607 | 500.000 | 3.527.685.607 |
| Staatsanleihen | – | 1.205.827.702 | – | 1.205.827.702 |
| Investmentfonds | – | 70.347.000 | – | 70.347.000 |
| Schatzwechsel | – | 51.075.667 | – | 51.075.667 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 46.700.064 | – | 46.700.064 |
| Vermögenswerte insgesamt | – | 4.901.136.040 | 500.000 | 4.901.636.040 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3* US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|---------------------|------------------|---------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | – | (1.843.240) | – | (1.843.240) |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (23.986.773) | – | (23.986.773) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (25.830.013) | – | (25.830.013) |

* Unternehmensanleihen der Stufe 3 wurden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren bewertet.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|
| Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 3 | | | |
| Unternehmensanleihen | – | (500.000) | 500.000 |

Zum Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 wurde eine Unternehmensanleihe von Stufe 2 in Stufe 3 übertragen, da von den Direktoren genehmigten Preisfindungsverfahren verwendet werden.

Short Duration High Yield SDG Engagement

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3* US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------|--------------------|------------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Unternehmensanleihen | – | 659.326.845 | 4.686.892 | 664.013.737 |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen | – | 12.793.556 | 626.491 | 13.420.047 |
| Investmentfonds | 241.028 | – | – | 241.028 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 15.254.920 | – | 15.254.920 |
| Vermögenswerte insgesamt | 241.028 | 687.375.321 | 5.313.383 | 692.929.732 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3* US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|--------------------|------------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (3.114.085) | – | (3.114.085) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (3.114.085) | – | (3.114.085) |

*Eine Unternehmensanleihe der Stufe 3 wurde in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren bewertet.

Eine mittelfristige Schuldverschreibung der Stufe 3 wurde basierend auf einer von einem Händler verfügbaren Einzelnotierung bewertet. Das Portfolio hat keinen Zugang zu nicht beobachtbaren Parametern und kann daher derartige Parameter, die bei der Erstellung dieser Gleichung eingesetzt werden, nicht offenlegen.

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|
| Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 3 | | | |
| Unternehmensanleihen | – | (900.513) | 900.513 |

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurde eine Unternehmensanleihe von Stufe 2 in Stufe 3 übertragen, da von den Direktoren genehmigten Preisfindungsverfahren verwendet werden.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Unternehmensanleihen | – | 477.638.711 | – | 477.638.711 |
| Investmentfonds | 1.221.039 | – | – | 1.221.039 |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen | – | 23.578.927 | – | 23.578.927 |
| Schatzwechsel | – | 10.810.063 | – | 10.810.063 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 23.012.144 | – | 23.012.144 |
| Vermögenswerte insgesamt | 1.221.039 | 535.039.845 | – | 536.260.884 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (5.286.451) | – | (5.286.451) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (5.286.451) | – | (5.286.451) |

Strategic Income

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3* US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|------------------|----------------------|------------------|----------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | – | 22.512 | – | 22.512 |
| Schatzwechsel | – | 221.166.130 | – | 221.166.130 |
| Agency Bonds | – | 781.434 | – | 781.434 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | – | 211.031.917 | – | 211.031.917 |
| Unternehmensanleihen | – | 534.569.806 | 1.274.504 | 535.844.310 |
| Staatsanleihen | – | 175.669.880 | – | 175.669.880 |
| Mortgage-Backed Securities | – | 918.338.562 | – | 918.338.562 |
| Kommunalanleihen | – | 12.918.823 | – | 12.918.823 |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen | – | 429.819 | – | 429.819 |
| Investmentfonds | 145.814 | 60.620.640 | – | 60.766.454 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 20.251.351 | – | 20.251.351 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 3.637.375 | – | – | 3.637.375 |
| Beizulegender Zeitwert aus gekauften Swaptions | – | 15.122 | – | 15.122 |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | – | 905.422 | – | 905.422 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten | – | 834.927 | – | 834.927 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten | – | 461.585 | – | 461.585 |
| Vermögenswerte insgesamt | 3.783.189 | 2.158.017.930 | 1.274.504 | 2.163.075.623 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Strategic Income (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3* US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|---------------------|--------------------|------------------|---------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (5.513.615) | – | (5.513.615) |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (18.576.468) | – | – | (18.576.468) |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten | – | (1.085.681) | – | (1.085.681) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | (18.576.468) | (6.599.296) | – | (25.175.764) |

* Unternehmensanleihen der Stufe 3 wurden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren bewertet.

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|
| Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 3 | | | |
| Unternehmensanleihen | – | (1.274.504) | 1.274.504 |

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden bestimmte Unternehmensanleihen von Stufe 2 in Stufe 3 übertragen, da von den Direktoren genehmigten Preisfindungsverfahren verwendet werden.

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3* US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|------------------|----------------------|------------------|----------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Agency Bonds | – | 772.053 | – | 772.053 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | – | 105.467.359 | – | 105.467.359 |
| Unternehmensanleihen | – | 637.567.177 | – | 637.567.177 |
| Staatsanleihen | – | 243.357.365 | – | 243.357.365 |
| Investmentfonds | 738.685 | 57.487.152 | – | 58.225.837 |
| Mortgage-Backed Securities | – | 346.893.475 | – | 346.893.475 |
| Kommunalanleihen | – | 20.744.098 | – | 20.744.098 |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen | – | 453.664 | 126.140 | 579.804 |
| Schatzwechsel | – | 8.017.122 | – | 8.017.122 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 29.520.687 | – | 29.520.687 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 2.904.814 | – | – | 2.904.814 |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | – | 25.894 | – | 25.894 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten | – | 451.266 | – | 451.266 |
| Vermögenswerte insgesamt | 3.643.499 | 1.450.757.312 | 126.140 | 1.454.526.951 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Strategic Income (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3* US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|--------------------|---------------------|------------------|---------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (7.161.491) | – | (7.161.491) |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (1.425.842) | – | – | (1.425.842) |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | – | (97.587) | – | (97.587) |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten | – | (916.187) | – | (916.187) |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten | – | (3.863.949) | – | (3.863.949) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | (1.425.842) | (12.039.214) | – | (13.465.056) |

* Mittelfristige Schuldverschreibungen der Stufe 3 wurden basierend auf von Händlern verfügbaren Einzelnotierungen bewertet. Das Portfolio hat keinen Zugang zu nicht beobachtbaren Parametern und kann daher derartige Parameter, die bei der Erstellung dieser Gleichung eingesetzt werden, nicht offenlegen.

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|
| Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 3 | | | |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen | – | (126.140) | 126.140 |

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 wurde ein Laufzeitkredit von Stufe 2 in Stufe 3 übertragen, da die für die Bewertung dieses Laufzeitkredits verfügbaren Dealerquotierungen zurückgegangen sind.

Sustainable Asia High Yield

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Unternehmensanleihen | – | 24.364.117 | – | 24.364.117 |
| Staatsanleihen | – | 2.505.094 | – | 2.505.094 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 16.926 | – | 16.926 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 23.897 | – | – | 23.897 |
| Vermögenswerte insgesamt | 23.897 | 26.886.137 | – | 26.910.034 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (496) | – | (496) |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (58.271) | – | – | (58.271) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | (58.271) | (496) | – | (58.767) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Sustainable Asia High Yield (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Unternehmensanleihen | – | 27.495.016 | – | 27.495.016 |
| Staatsanleihen | – | 837.924 | – | 837.924 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 282.337 | – | 282.337 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 13.122 | – | – | 13.122 |
| Vermögenswerte insgesamt | 13.122 | 28.615.277 | – | 28.628.399 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (29.229) | – | (29.229) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (29.229) | – | (29.229) |

Sustainable Emerging Market Corporate Debt

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Unternehmensanleihen | – | 83.464.415 | – | 83.464.415 |
| Staatsanleihen | – | 7.168.384 | – | 7.168.384 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 1.906.675 | – | 1.906.675 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 27.031 | – | – | 27.031 |
| Vermögenswerte insgesamt | 27.031 | 92.539.474 | – | 92.566.505 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|------------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (235.957) | – | (235.957) |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (236.161) | – | – | (236.161) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | (236.161) | (235.957) | – | (472.118) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Sustainable Emerging Market Corporate Debt (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Unternehmensanleihen | – | 86.982.672 | – | 86.982.672 |
| Staatsanleihen | – | 4.401.408 | – | 4.401.408 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 853.222 | – | 853.222 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 49.937 | – | – | 49.937 |
| Vermögenswerte insgesamt | 49.937 | 92.237.302 | – | 92.287.239 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (134.345) | – | (134.345) |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (7.617) | – | – | (7.617) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | (7.617) | (134.345) | – | (141.962) |

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency²

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Unternehmensanleihen | – | 28.120.429 | – | 28.120.429 |
| Staatsanleihen | – | 387.681.779 | – | 387.681.779 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 8.781.301 | – | 8.781.301 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 7.590.987 | – | – | 7.590.987 |
| Vermögenswerte insgesamt | 7.590.987 | 424.583.509 | – | 432.174.496 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|--------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (2.051.066) | – | (2.051.066) |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (3.655.629) | – | – | (3.655.629) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | (3.655.629) | (2.051.066) | – | (5.706.695) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency² (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Unternehmensanleihen | – | 7.708.197 | – | 7.708.197 |
| Staatsanleihen | – | 136.106.159 | – | 136.106.159 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 1.237.337 | – | 1.237.337 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 2.512.729 | – | – | 2.512.729 |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | – | 53.826 | – | 53.826 |
| Vermögenswerte insgesamt | 2.512.729 | 145.105.519 | – | 147.618.248 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (862.058) | – | (862.058) |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (46.430) | – | – | (46.430) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | (46.430) | (862.058) | – | (908.488) |

Tactical Macro¹

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Schatzwechsel | – | 22.994.103 | – | 22.994.103 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 67.331 | – | 67.331 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 8.973 | – | – | 8.973 |
| Gekaufte Optionskontrakte | 267.084 | 92.215 | – | 359.299 |
| Vermögenswerte insgesamt | 276.057 | 23.153.649 | – | 23.429.706 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|------------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (36.811) | – | (36.811) |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (28.337) | – | – | (28.337) |
| Verkaufte Optionskontrakte | (115.463) | (81.790) | – | (197.253) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | (143.800) | (118.601) | – | (262.401) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Ultra Short Term Euro Bond

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 EUR | Stufe 2 EUR | Stufe 3 EUR | Insgesamt EUR |
|---|----------------|--------------------|----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Schatzwechsel | – | 8.960.964 | – | 8.960.964 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | – | 90.687.160 | – | 90.687.160 |
| Unternehmensanleihen | – | 789.167.617 | – | 789.167.617 |
| Staatsanleihen | – | 75.386.047 | – | 75.386.047 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 235.719 | – | 235.719 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 509.420 | – | – | 509.420 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten | – | 531.378 | – | 531.378 |
| Vermögenswerte insgesamt | 509.420 | 964.968.885 | – | 965.478.305 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 EUR | Stufe 2 EUR | Stufe 3 EUR | Insgesamt EUR |
|---|--------------------|--------------------|----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (2.512.078) | – | (2.512.078) |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (2.783.686) | – | – | (2.783.686) |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | – | (2.179.454) | – | (2.179.454) |
| Nicht realisierter Verlust aus Inflation-Swap-Kontrakten | – | (293.227) | – | (293.227) |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten | – | (248.422) | – | (248.422) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | (2.783.686) | (5.233.181) | – | (8.016.867) |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 EUR | Stufe 2 EUR | Stufe 3 EUR | Insgesamt EUR |
|---|------------------|--------------------|----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | – | 72.343.961 | – | 72.343.961 |
| Unternehmensanleihen | – | 670.503.994 | – | 670.503.994 |
| Staatsanleihen | – | 56.450.113 | – | 56.450.113 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten | – | 9.296 | – | 9.296 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 232.108 | – | 232.108 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 9.402.701 | – | – | 9.402.701 |
| Vermögenswerte insgesamt | 9.402.701 | 799.539.472 | – | 808.942.173 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Ultra Short Term Euro Bond (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 EUR | Stufe 2 EUR | Stufe 3 EUR | Insgesamt EUR |
|---|--------------------|--------------------|----------------|---------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (6.570.781) | – | (6.570.781) |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (1.719.108) | – | – | (1.719.108) |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | – | (543.950) | – | (543.950) |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten | – | (1.735.988) | – | (1.735.988) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | (1.719.108) | (8.850.719) | – | (10.569.827) |

Uncorrelated Strategies

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3* US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|--------------------|----------------------|------------------|----------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Unternehmensanleihen | – | 120.618.827 | – | 120.618.827 |
| Aktien | 77.292.452 | – | – | 77.292.452 |
| Staatsanleihen | – | 38.964.571 | – | 38.964.571 |
| Participatory Notes | 16.551 | 20.494 | – | 37.045 |
| Immobilienaktiengesellschaften | 1.217.656 | – | – | 1.217.656 |
| Schatzwechsel | – | 707.195.701 | – | 707.195.701 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 91.871.867 | – | 91.871.867 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 18.420.818 | – | – | 18.420.818 |
| Gekaufte Optionskontrakte | 76.813.301 | 205.683.748 | 739.333 | 283.236.382 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Differenzkontrakten | – | 106.922.939 | 622 | 106.923.561 |
| Gekaufte Swaptions | – | 40.202 | – | 40.202 |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | – | 686.246 | – | 686.246 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten | – | 3.727.082 | – | 3.727.082 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten | – | 3.395.463 | – | 3.395.463 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Correlation-Swap-Kontrakten | – | 379.911 | – | 379.911 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Variance-Swap-Kontrakten | – | 85.377 | 3.742.835 | 3.828.212 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Volatility-Swap-Kontrakten | – | 15.951.941 | 2.474.234 | 18.426.175 |
| Vermögenswerte insgesamt | 173.760.778 | 1.295.544.369 | 6.957.024 | 1.476.262.171 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3* US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|---------------------|----------------------|------------------|----------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (53.084.382) | – | (53.084.382) |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (24.576.840) | (16.558) | – | (24.593.398) |
| Verkaufte Optionskontrakte | (24.217.092) | (354.499.520) | (612) | (378.717.224) |
| Nicht realisierter Verlust aus Differenzkontrakten | – | (20.286.524) | (404.714) | (20.691.238) |
| Verkaufte Swaptionen | – | (29.043) | – | (29.043) |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | – | (1.305.860) | – | (1.305.860) |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten | – | (9.089.737) | – | (9.089.737) |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten | – | (3.021.166) | – | (3.021.166) |
| Nicht realisierter Verlust aus Variance-Swap-Kontrakten | – | (418.672) | (96.004) | (514.676) |
| Nicht realisierter Verlust aus Volatility-Swap-Kontrakten | – | (8.805.597) | (105.892) | (8.911.489) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | (48.793.932) | (450.557.059) | (607.222) | (499.958.213) |

* Optionskontrakte, Differenzkontrakte, Variance- und Volatility-Swaps der Stufe 3 wurden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren und/oder auf der Basis der Notierung eines einzigen Händlers bewertet.

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|
| Übertragungen von Stufe 1 in Stufe 2 | | | |
| Optionskontrakte | (425.350) | 425.350 | – |
| Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 3 | | | |
| Variance-Swap-Kontrakte | – | (446.251) | 446.251 |
| Volatility-Swap-Kontrakte | – | (1.641.552) | 1.641.552 |
| Übertragungen von Stufe 1 in Stufe 3 | | | |
| Differenzkontrakte | (622) | – | 622 |
| Optionskontrakte | (55.703) | – | 55.703 |

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden Optionskontrakte und Differenzkontrakte von Stufe 1 in Stufe 3 übertragen, da von den Direktoren genehmigten Preisfindungsverfahren verwendet werden. Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden Optionskontrakte von Stufe 1 in Stufe 2 übertragen, da die für die Bewertung verfügbaren Dealerquotierungen zurückgegangen sind. Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden Variance-Swap-Kontrakte und Volatility-Swap-Kontrakte von Stufe 2 in Stufe 3 übertragen, da von den Direktoren genehmigten Preisfindungsverfahren verwendet werden.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3* US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|--------------------|----------------------|------------------|----------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Unternehmensanleihen | – | 161.387.060 | – | 161.387.060 |
| Aktien | 135.368.028 | – | – | 135.368.028 |
| Staatsanleihen | – | 4.218.750 | – | 4.218.750 |
| Participatory Notes | 21.440 | – | – | 21.440 |
| Immobilienaktiengesellschaften | 4.976.282 | – | – | 4.976.282 |
| Schatzwechsel | – | 1.582.793.462 | – | 1.582.793.462 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 212.294.005 | – | 212.294.005 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 40.643.851 | – | – | 40.643.851 |
| Gekaufte Optionskontrakte | 73.572.721 | 128.636.328 | 551.147 | 202.760.196 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Differenzkontrakten | – | 78.117.298 | 714 | 78.118.012 |
| Gekaufte Swaptions | – | 1.388.392 | – | 1.388.392 |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | – | 1.435.658 | – | 1.435.658 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten | – | 65.682.162 | – | 65.682.162 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten | – | 27.160.802 | – | 27.160.802 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten | – | 3.899.449 | – | 3.899.449 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Correlation-Swap-Kontrakten | – | 700.944 | – | 700.944 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Variance-Swap-Kontrakten | – | 971.550 | – | 971.550 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Volatility-Swap-Kontrakten | – | 32.121.676 | – | 32.121.676 |
| Vermögenswerte insgesamt | 254.582.322 | 2.300.807.536 | 551.861 | 2.555.941.719 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3* US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------|-----------------|------------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (37.812.332) | – | (37.812.332) |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (25.288.052) | – | – | (25.288.052) |
| Verkaufte Optionskontrakte | (25.955.164) | (284.022.074) | (5.880) | (309.983.118) |
| Nicht realisierter Verlust aus Differenzkontrakten | – | (58.427.650) | (288.575) | (58.716.225) |
| Verkaufte Swaptionen | – | (708.024) | – | (708.024) |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | – | (526.998) | – | (526.998) |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten | – | (23.945.145) | – | (23.945.145) |
| Nicht realisierter Verlust aus Inflation-Swap-Kontrakten | – | (26.861.904) | – | (26.861.904) |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten | – | (1.242.422) | – | (1.242.422) |
| Nicht realisierter Verlust aus Correlation-Swap-Kontrakten | – | (60.576) | – | (60.576) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3* US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|---------------------|----------------------|------------------|----------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten (Fortsetzung) | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Variance-Swap-Kontrakten | – | (421.247) | – | (421.247) |
| Nicht realisierter Verlust aus Volatility-Swap-Kontrakten | – | (4.417.825) | – | (4.417.825) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | (51.243.216) | (438.446.197) | (294.455) | (489.983.868) |

* Optionen und Differenzkontrakte der Stufe 3 wurden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren und/oder auf der Basis der Notierung eines einzigen Händlers bewertet.

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|
| Übertragungen von Stufe 3 in Stufe 2 | | | |
| Differenzkontrakte | – | 215.193 | (215.193) |
| Correlation-Swap-Kontrakte | – | 700.944 | (700.944) |
| Volatility-Swap-Kontrakte | – | 17.959.222 | (17.959.222) |
| Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 1 | | | |
| Aktien | 100.661.159 | (100.661.159) | – |
| Participatory Notes | 6.404 | (6.404) | – |
| Immobilienaktiengesellschaften | 4.976.282 | (4.976.282) | – |

Zum Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 wurden Correlation Swap-Kontrakte und Volatility Swap-Kontrakte von Stufe 3 in Stufe 2 übertragen, da die von den Direktoren genehmigten Bewertungsverfahren nicht mehr verwendet werden. Zum Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 wurden Aktien, Participatory Notes und Immobilienaktiengesellschaften von Stufe 2 in Stufe 1 übertragen, da die Preisfindung durch einen Pricing-Anbieter erfolgte.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Uncorrelated Trading^{2*}

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3** US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-------------------|--------------------|-------------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Unternehmensanleihen | – | 13.221.435 | – | 13.221.435 |
| Aktien | 16.089.324 | – | – | 16.089.324 |
| Immobilienaktiengesellschaften | 3.946.436 | – | – | 3.946.436 |
| Schatzwechsel | – | 449.200.010 | – | 449.200.010 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 54.485.356 | – | 54.485.356 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 8.521.839 | – | – | 8.521.839 |
| Gekaufte Optionskontrakte | 15.415.785 | 20.361.008 | 81.777 | 35.858.570 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Differenzkontrakten | – | 13.934.583 | – | 13.934.583 |
| Gekaufte Swaptions | – | 68.848 | – | 68.848 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten | – | 1.024.404 | – | 1.024.404 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten | – | 678.244 | – | 678.244 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Variance-Swap-Kontrakten | – | 319.127 | – | 319.127 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Volatility-Swap-Kontrakten | – | 1.343.255 | – | 1.343.255 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Correlation-Swap-Kontrakten | – | 0 | – | 0 |
| Vermögenswerte insgesamt | 43.973.384 | 554.636.270 | 81.777 | 598.691.431 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3** US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|---------------------|---------------------|-------------------|---------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (6.317.151) | – | (6.317.151) |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (4.922.598) | – | – | (4.922.598) |
| Verkaufte Optionskontrakte | (5.613.286) | (36.846.894) | – | (42.460.180) |
| Nicht realisierter Verlust aus Differenzkontrakten | – | (3.269.736) | – | (3.269.736) |
| Verkaufte Swaptionen | – | (20.738) | – | (20.738) |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | – | (47.926) | – | (47.926) |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten | – | (1.000.582) | – | (1.000.582) |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten | – | (13.154) | – | (13.154) |
| Nicht realisierter Verlust aus Variance-Swap-Kontrakten | – | (332.219) | – | (332.219) |
| Nicht realisierter Verlust aus Volatility-Swap-Kontrakten | – | (939.941) | – | (939.941) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | (10.535.884) | (48.788.341) | – | (59.324.225) |

* Das Portfolio wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

**Alle Optionen der Stufe 3 wurden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren bewertet.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

US Equity

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-------------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | 45.872.647 | – | – | 45.872.647 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 1.253.492 | – | 1.253.492 |
| Vermögenswerte insgesamt | 45.872.647 | 1.253.492 | – | 47.126.139 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (118.963) | – | (118.963) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (118.963) | – | (118.963) |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-------------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | 27.005.260 | – | – | 27.005.260 |
| Immobilienaktiengesellschaften | 478.769 | – | – | 478.769 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 2.158.080 | – | 2.158.080 |
| Vermögenswerte insgesamt | 27.484.029 | 2.158.080 | – | 29.642.109 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (546.931) | – | (546.931) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (546.931) | – | (546.931) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

US Equity Index PutWrite

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Staatsanleihen | – | 663.357.136 | – | 663.357.136 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 12.128.805 | – | 12.128.805 |
| Vermögenswerte insgesamt | – | 675.485.941 | – | 675.485.941 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|--------------------|------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (538.104) | – | (538.104) |
| Verkaufte Optionskontrakte | (5.184.365) | (67.430) | – | (5.251.795) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | (5.184.365) | (605.534) | – | (5.789.899) |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Staatsanleihen | – | 632.264.076 | – | 632.264.076 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 16.592.327 | – | 16.592.327 |
| Vermögenswerte insgesamt | – | 648.856.403 | – | 648.856.403 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|---------------------|--------------------|-----------------|---------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Verkaufte Optionskontrakte | (12.932.325) | – | – | (12.932.325) |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (1.350.871) | – | (1.350.871) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | (12.932.325) | (1.350.871) | – | (14.283.196) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

US Large Cap Value

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|----------------------|------------------|-----------------|----------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | 1.847.675.317 | – | – | 1.847.675.317 |
| Immobilienaktiengesellschaften | 3.901.309 | – | – | 3.901.309 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 1.119.012 | – | 1.119.012 |
| Vermögenswerte insgesamt | 1.851.576.626 | 1.119.012 | – | 1.852.695.638 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (115.827) | – | (115.827) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (115.827) | – | (115.827) |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|----------------------|-----------------|-----------------|----------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | 1.688.625.847 | – | – | 1.688.625.847 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 973.737 | – | 973.737 |
| Vermögenswerte insgesamt | 1.688.625.847 | 973.737 | – | 1.689.599.584 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (102.612) | – | (102.612) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (102.612) | – | (102.612) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

US Long Short Equity

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3* US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|--------------------|-------------------|------------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | 165.044.733 | – | 1.538.670 | 166.583.403 |
| Immobilienaktiengesellschaften | 3.534.047 | – | – | 3.534.047 |
| Unternehmensanleihen | – | 7.670.535 | – | 7.670.535 |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen | – | – | 487.831 | 487.831 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 3.283.704 | – | 3.283.704 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Differenzkontrakten | – | 624.429 | – | 624.429 |
| Vermögenswerte insgesamt | 168.578.780 | 11.578.668 | 2.026.501 | 182.183.949 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3* US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|--------------------|--------------------|------------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (342.870) | – | (342.870) |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten | (1.003.428) | – | – | (1.003.428) |
| Verkaufte Optionskontrakte | (15.714) | – | – | (15.714) |
| Nicht realisierter Verlust aus Differenzkontrakten | – | (2.740.096) | – | (2.740.096) |
| Nicht realisierter Verlust aus Return--Swap-Kontrakten | – | (4.635.993) | – | (4.635.993) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | (1.019.142) | (7.718.959) | – | (8.738.101) |

* Eine Aktie, eine Unternehmensanleihe und eine mittelfristige Schuldverschreibung der Stufe 3 wurden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren bewertet.

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|
| Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 1 | | | |
| Aktien | 1.648.923 | (1.648.923) | – |

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurde eine Aktie von Stufe 2 in Stufe 1 übertragen, da die Preisfindung durch einen Pricing-Anbieter erfolgte.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

US Long Short Equity (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|--------------------|-------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Unternehmensanleihen | – | 8.400.448 | – | 8.400.448 |
| Aktien | 156.744.366 | 1.265.964 | – | 158.010.330 |
| Participatory Notes | 3.750 | – | – | 3.750 |
| Immobilienaktiengesellschaften | 1.744.930 | – | – | 1.744.930 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 6.686.844 | – | 6.686.844 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten | 470.254 | – | – | 470.254 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Differenzkontrakten | – | 3.162.728 | – | 3.162.728 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten | – | 664.406 | – | 664.406 |
| Vermögenswerte insgesamt | 158.963.300 | 20.180.390 | – | 179.143.690 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Verkaufte Optionskontrakte | (74.360) | – | – | (74.360) |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (822.791) | – | (822.791) |
| Nicht realisierter Verlust aus Differenzkontrakten | – | (1.291.811) | – | (1.291.811) |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten | – | (700.901) | – | (700.901) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | (74.360) | (2.815.503) | – | (2.889.863) |

US Multi Cap Opportunities

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|--------------------|------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | 396.982.739 | – | – | 396.982.739 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 1.843.892 | – | 1.843.892 |
| Vermögenswerte insgesamt | 396.982.739 | 1.843.892 | – | 398.826.631 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (325.170) | – | (325.170) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (325.170) | – | (325.170) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|--------------------|------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | 439.025.865 | – | – | 439.025.865 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 2.736.142 | – | 2.736.142 |
| Vermögenswerte insgesamt | 439.025.865 | 2.736.142 | – | 441.762.007 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (587.402) | – | (587.402) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (587.402) | – | (587.402) |

US Real Estate Securities

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|--------------------|------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Immobilienaktiengesellschaften | 519.992.632 | – | – | 519.992.632 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 2.358.847 | – | 2.358.847 |
| Vermögenswerte insgesamt | 519.992.632 | 2.358.847 | – | 522.351.479 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (441.683) | – | (441.683) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (441.683) | – | (441.683) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|--------------------|------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Immobilienaktiengesellschaften | 624.531.489 | – | – | 624.531.489 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 4.089.640 | – | 4.089.640 |
| Vermögenswerte insgesamt | 624.531.489 | 4.089.640 | – | 628.621.129 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (1.230.032) | – | (1.230.032) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (1.230.032) | – | (1.230.032) |

US Small Cap

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|--------------------|------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | 618.452.600 | 3.839.310 | – | 622.291.910 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 747.370 | – | 747.370 |
| Vermögenswerte insgesamt | 618.452.600 | 4.586.680 | – | 623.039.280 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (137.144) | – | (137.144) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (137.144) | – | (137.144) |

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|
| Übertragungen von Stufe 1 in Stufe 2 | | | |
| Aktien | (3.839.310) | 3.839.310 | – |

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurde eine Aktie von Stufe 1 in Stufe 2 übertragen, da die für die Bewertung verfügbaren Dealerquotierungen zurückgegangen sind.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

US Small Cap (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|--------------------|-----------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | 578.779.674 | – | – | 578.779.674 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | – | 949.457 | – | 949.457 |
| Vermögenswerte insgesamt | 578.779.674 | 949.457 | – | 579.729.131 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3 US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (236.699) | – | (236.699) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (236.699) | – | (236.699) |

US Small Cap Intrinsic Value

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3* US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|--------------------|-----------------|------------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | 299.826.372 | – | – | 299.826.372 |
| Immobilienaktiengesellschaften | 1.910.421 | – | – | 1.910.421 |
| Vermögenswerte insgesamt | 301.736.793 | – | – | 301.736.793 |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3* US\$ | Insgesamt US\$ |
|--|-----------------|-----------------|------------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | – | (398) | – | (398) |
| Verbindlichkeiten, insgesamt | – | (398) | – | (398) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

US Small Cap Intrinsic Value (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

| | Stufe 1 US\$ | Stufe 2 US\$ | Stufe 3* US\$ | Insgesamt US\$ |
|---|--------------------|-----------------|------------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte | | | | |
| Aktien | 184.718.734 | – | – | 184.718.734 |
| Immobilienaktiengesellschaften | 2.170.638 | – | – | 2.170.638 |
| Vermögenswerte insgesamt | 186.889.372 | – | – | 186.889.372 |

* Eine Aktie und eine Unternehmensanleihe der Stufe 3 wurden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren bewertet.

¹ Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

² Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

Die folgende Aufstellung enthält eine Überleitung der Anlagen, deren Wert per 31. Dezember 2023 unter Anwendung nicht beobachtbarer Parameter (Stufe 3) ermittelt wurde:

Absolute Return Multi Strategy*

| | Insgesamt US\$ |
|---|-------------------|
| Saldo per 1. Januar 2023 | 6.766 |
| Realisierter Nettoverlust | (4) |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Verlustes | (451) |
| Saldo per 31. Dezember 2023 | 6.311 |

* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

Global Flexible Credit Income

| | Insgesamt US\$ |
|--|-------------------|
| Saldo per 1. Januar 2023 | 5.247.334 |
| Käufe | 1.293.983 |
| Übertragung in Stufe 3 | 247.792 |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes | 738.144 |
| Saldo per 31. Dezember 2023 | 7.527.253 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Global High Yield SDG Engagement

| | Insgesamt US\$ |
|---|-------------------|
| Saldo per 1. Januar 2023 | 325.875 |
| Käufe | 1.847.363 |
| Verkäufe | (1.206.234) |
| Realisierter Nettogewinn | 686 |
| Übertragung in Stufe 3 | 1.136.259 |
| Übertragung aus Stufe 3 | (4.933) |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Verlustes | (64.706) |
| Saldo per 31. Dezember 2023 | 2.034.310 |

High Yield Bond

| | Insgesamt US\$ |
|---|-------------------|
| Saldo per 1. Januar 2023 | 5.791.687 |
| Käufe | 16.834.056 |
| Verkäufe | (13.429.241) |
| Realisierter Nettoverlust | (340.284) |
| Übertragung in Stufe 3 | 7.195.550 |
| Übertragung aus Stufe 3 | (4.940) |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Verlustes | (1.385.403) |
| Saldo per 31. Dezember 2023 | 14.661.425 |

Short Duration Emerging Market Debt

| | Insgesamt US\$ |
|--|-------------------|
| Saldo per 1. Januar 2023 | 500.000 |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes | – |
| Saldo per 31. Dezember 2023 | 500.000 |

Short Duration High Yield SDG Engagement

| | Insgesamt US\$ |
|---|-------------------|
| Saldo per 1. Januar 2023 | – |
| Käufe | 8.248.058 |
| Verkäufe | (3.688.538) |
| Realisierter Nettogewinn | 97.959 |
| Übertragung in Stufe 3 | 900.513 |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Verlustes | (244.609) |
| Saldo per 31. Dezember 2023 | 5.313.383 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Strategic Income

| | Insgesamt US\$ |
|--|-------------------|
| Saldo per 1. Januar 2023 | 126.140 |
| Käufe | 796.760 |
| Verkäufe | (299.057) |
| Realisierter Nettoverlust | (60.212) |
| Übertragung in Stufe 3 | 605.611 |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes | 105.262 |
| Saldo per 31. Dezember 2023 | 1.274.504 |

Uncorrelated Trading*

| | Insgesamt US\$ |
|--|-------------------|
| Saldo per 1. Januar 2023 | 81.777 |
| Verkäufe | (42.151) |
| Realisierter Nettoverlust | (963.789) |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes | 924.163 |
| Saldo per 31. Dezember 2023 | – |

* Das Portfolio wurde am 24. Mai 2024 aufgelöst.

Uncorrelated Strategies

| | Insgesamt US\$ |
|--|-------------------|
| Saldo per 1. Januar 2023 | 257.406 |
| Käufe | 8.232.754 |
| Verkäufe | (180.900) |
| Übertragung in Stufe 3 | 2.144.128 |
| Realisierter Nettoverlust | (11.232.258) |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes | 7.128.672 |
| Saldo per 31. Dezember 2023 | 6.349.802 |

US Long Short Equity

| | Insgesamt US\$ |
|------------------------------------|-------------------|
| Saldo per 1. Januar 2023 | – |
| Käufe | 2.026.501 |
| Saldo per 31. Dezember 2023 | 2.026.501 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Die folgende Aufstellung enthält eine Überleitung der Anlagen, deren Wert per 31. Dezember 2022 unter Anwendung nicht beobachtbarer Parameter (Stufe 3) ermittelt wurde:

Absolute Return Multi Strategy*

| | Insgesamt US\$ |
|---|-------------------|
| Saldo per 1. Januar 2022 | 31.388 |
| Verkäufe | (32.202) |
| Realisierter Nettogewinn | 32.201 |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Verlustes | (24.621) |
| Saldo per 31. Dezember 2022 | 6.766 |

* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

Global Flexible Credit Income

| | Insgesamt US\$ |
|--|-------------------|
| Saldo per 1. Januar 2022 | – |
| Käufe | 4.900.000 |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes | 347.334 |
| Saldo per 31. Dezember 2022 | 5.247.334 |

Global High Yield SDG Engagement

| | Insgesamt US\$ |
|---|-------------------|
| Saldo per 1. Januar 2022 | – |
| Käufe | 329.588 |
| Verkäufe | (833) |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Verlustes | (2.880) |
| Saldo per 31. Dezember 2022 | 325.875 |

High Yield Bond

| | Insgesamt US\$ |
|---|-------------------|
| Saldo per 1. Januar 2022 | 26.761.291 |
| Käufe | 6.332.158 |
| Verkäufe | (12.108.694) |
| Realisierter Nettoverlust | (337.028) |
| Übertragung aus Stufe 3 | (13.907.802) |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Verlustes | (948.237) |
| Saldo per 31. Dezember 2022 | 5.791.688 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Multi-Asset Income

| | Insgesamt US\$ |
|--|-------------------|
| Saldo per 1. Januar 2022 | 76 |
| Käufe | 6 |
| Realisierter Nettoverlust | (104) |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes | 22 |
| Saldo per 31. Dezember 2022 | – |

Short Duration Emerging Market Debt

| | Insgesamt US\$ |
|------------------------------------|-------------------|
| Saldo per 1. Januar 2022 | – |
| Übertragung in Stufe 3 | 500.000 |
| Saldo per 31. Dezember 2022 | 500.000 |

Short Duration High Yield SDG Engagement

| | Insgesamt US\$ |
|---|-------------------|
| Saldo per 1. Januar 2022 | 1.599.050 |
| Verkäufe | (1.595.047) |
| Realisierter Nettogewinn | 7.428 |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Verlustes | (11.431) |
| Saldo per 31. Dezember 2022 | – |

Strategic Income

| | Insgesamt US\$ |
|---|-------------------|
| Saldo per 1. Januar 2022 | 1.573.993 |
| Käufe | (145.736) |
| Verkäufe | (1.411.261) |
| Realisierter Nettogewinn | 1.032 |
| Übertragung in Stufe 3 | 126.140 |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Verlustes | (18.028) |
| Saldo per 31. Dezember 2022 | 126.140 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Uncorrelated Strategies

| | Insgesamt US\$ |
|--|-------------------|
| Saldo per 1. Januar 2022 | 853.542 |
| Käufe | 774.404.693 |
| Verkäufe | (776.937.850) |
| Realisierter Nettogewinn | 10.300.712 |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes | 10.511.668 |
| Übertragung aus Stufe 3 | (18.660.166) |
| Übertragung in Stufe 3 | (215.193) |
| Saldo per 31. Dezember 2022 | 257.406 |

Uncorrelated Trading¹

| | Insgesamt US\$ |
|--|-------------------|
| Saldo per 1. Januar 2022 | – |
| Käufe | 1.031.664 |
| Verkäufe | (25.724) |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) | (924.163) |
| Saldo per 31. Dezember 2022 | 81.777 |

¹ Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

Laufzeitkredite der Stufe 3 sind in erster Linie auf die Preisfindungsmethode zurückzuführen, bei der eine einzelne Broker-Quotierungen (Stufe 3) oder ein einzelner beobachtbare Parameter (Stufe 3) durch den unabhängigen Pricing-Service-Anbieter verwendet wird. Alle anderen Wertpapiere der Stufe 3 werden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren bewertet.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT

5G Connectivity

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse AUD A NIW | Thesaurierende Klasse AUD A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse AUD I2* NIW | Thesaurierende Klasse AUD I2* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse CHF A* NIW | Thesaurierende Klasse CHF A* NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|--------------------------------------|--|-------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 20.787.257 AUD | 10,77 AUD | 52.808 AUD | 11,32 AUD | 27.888 CHF | 10,62 CHF |
| 31. Dezember 2022 | 17.057.259 AUD | 7,98 AUD | – | – | – | – |
| 31. Dezember 2021 | 38.403.196 AUD | 14,75 AUD | – | – | – | – |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse CHF I* NIW | Thesaurierende Klasse CHF I* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse CHF I2* NIW | Thesaurierende Klasse CHF I2* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse CNY A NIW | Thesaurierende Klasse CNY A NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|--------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 27.986 CHF | 10,65 CHF | 30.421 CHF | 11,37 CHF | 2.264.556 CNY | 76,51 CNY |
| 31. Dezember 2022 | – | – | – | – | 2.370.930 CNY | 57,01 CNY |
| 31. Dezember 2021 | – | – | – | – | 5.346.016 CNY | 101,38 CNY |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse CNY I2* NIW | Thesaurierende Klasse CNY I2* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR A NIW | Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil |
|-------------------|--------------------------------------|--|------------------------------------|--|---|---|
| 31. Dezember 2023 | 247.376 CNY | 113,42 CNY | 44.215.951 EUR | 11,22 EUR | 54.229.594 EUR | 12,48 EUR |
| 31. Dezember 2022 | – | – | 43.082.992 EUR | 8,32 EUR | 54.125.094 EUR | 9,34 EUR |
| 31. Dezember 2021 | – | – | 114.367.513 EUR | 15,39 EUR | 95.941.544 EUR | 15,55 EUR |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

5G Connectivity (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I NIW | Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I2* NIW | Thesaurierende Klasse EUR I2* NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------|---|---|---|-----------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 40.203.669 EUR | 10,50 EUR | 44.112.500 EUR | 12,14 EUR | 31.606 EUR | 11,32 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 39.268.790 EUR | 7,73 EUR | 43.589.698 EUR | 9,01 EUR | – | – |
| 31. Dezember 2021 | 76.903.936 EUR | 14,16 EUR | 118.101.577 EUR | 14,87 EUR | – | – |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW | Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP A NIW | Thesaurierende Klasse GBP A NIW je Anteil |
|-------------------|----------------------------------|--|---|---|---------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 18.694 EUR | 9,51 EUR | 58.300.824 EUR | 12,11 EUR | 9.193.764 GBP | 11,57 GBP |
| 31. Dezember 2022 | 1.352.834 EUR | 6,97 EUR | 44.772.549 EUR | 9,14 EUR | 10.322.335 GBP | 8,45 GBP |
| 31. Dezember 2021 | 3.965.517 EUR | 12,72 EUR | 69.554.657 EUR | 15,33 EUR | 23.031.741 GBP | 15,43 GBP |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I2* NIW | Thesaurierende Klasse GBP I2* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse HKD A NIW | Thesaurierende Klasse HKD A NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|-----------------------------------|---|---------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 295.419 GBP | 10,28 GBP | 27.290 GBP | 11,37 GBP | 49.137.389 HKD | 12,04 HKD |
| 31. Dezember 2022 | 535.353 GBP | 7,81 GBP | – | – | 47.629.183 HKD | 8,80 HKD |
| 31. Dezember 2021 | 1.009.328 GBP | 12,20 GBP | – | – | 133.998.798 HKD | 15,70 HKD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

5G Connectivity (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse HKD I2* NIW | Thesaurierende Klasse HKD I2* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse SGD A NIW | Thesaurierende Klasse SGD A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse SGD I2* NIW | Thesaurierende Klasse SGD I2* NIW je Anteil |
|-------------------|-----------------------------------|---|---------------------------------|---|-----------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 267.255 HKD | 11,39 HKD | 41.638.661 SGD | 23,47 SGD | 46.226 SGD | 22,67 SGD |
| 31. Dezember 2022 | – | – | 39.375.609 SGD | 17,27 SGD | – | – |
| 31. Dezember 2021 | – | – | 90.358.002 SGD | 31,05 SGD | – | – |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD A NIW | Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD E* NIW | Thesaurierende Klasse USD E* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I NIW | Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------|---|----------------------------------|--|---------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 439.282.138 USD | 12,60 USD | 708.213 USD | 11,92 USD | 126.685.506 USD | 13,65 USD |
| 31. Dezember 2022 | 421.532.776 USD | 9,12 USD | – | – | 144.216.650 USD | 9,79 USD |
| 31. Dezember 2021 | 998.982.677 USD | 16,17 USD | – | – | 426.247.636 USD | 17,22 USD |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD I NIW | Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I2 NIW | Thesaurierende Klasse USD I2 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I3 NIW | Thesaurierende Klasse USD I3 NIW je Anteil |
|-------------------|--------------------------------|--|----------------------------------|--|----------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 21.016.657 USD | 13,65 USD | 852.918 USD | 8,74 USD | 83.057.543 USD | 9,30 USD |
| 31. Dezember 2022 | 18.941.211 USD | 9,79 USD | 6.231.632 USD | 6,26 USD | 64.460.647 USD | 6,65 USD |
| 31. Dezember 2021 | 53.711.877 USD | 17,21 USD | 10.938.003 USD | 10,98 USD | 124.140.837 USD | 11,67 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

5G Connectivity (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I5 NIW | Thesaurierende Klasse USD I5 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD M NIW | Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD Z NIW | Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 15.006.722 USD | 12,70 USD | 25.425.604 USD | 11,02 USD | 951.757 USD | 8,78 USD |
| 31. Dezember 2022 | 11.306.667 USD | 9,07 USD | 23.507.641 USD | 8,04 USD | 700.508 USD | 6,24 USD |
| 31. Dezember 2021 | 39.945.606 USD | 15,89 USD | 50.689.515 USD | 14,37 USD | 954.074 USD | 10,88 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse ZAR A* NIW | Thesaurierende Klasse ZAR A* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse ZAR E* NIW | Thesaurierende Klasse ZAR E* NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 3.680.438 ZAR | 125,63 ZAR | 2.072.410 ZAR | 126,25 ZAR |

China A-Share Equity

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse CNY I NIW | Thesaurierende Klasse CNY I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) NIW | Ausschüttende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|---|---|--|--|
| 31. Dezember 2023 | 117.417 CNY | 80,34 CNY | 23.194 USD | 7,90 USD | 1.974.225 USD | 7,89 USD |
| 31. Dezember 2022 | 133.897 CNY | 91,62 CNY | 27.220 USD | 9,28 USD | 2.319.140 USD | 9,27 USD |
| 31. Dezember 2021 | 173.171 CNY | 118,49 CNY | 578.160 USD | 13,05 USD | 3.263.395 USD | 13,05 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

China Bond

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse CNY I* NIW | Ausschüttende Klasse CNY I* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse CNY Z NIW | Thesaurierende Klasse CNY Z NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---------------------------------|---|---------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 152.534 CNY | 76,55 CNY | 212.640 CNY | 90,61 CNY | 218.817 CNY | 119,47 CNY |
| 31. Dezember 2022 | 156.137 CNY | 78,36 CNY | 209.325 CNY | 89,19 CNY | 210.297 CNY | 114,82 CNY |
| 31. Dezember 2021 | 177.774 CNY | 89,21 CNY | 1.406.816 CNY | 97,60 CNY | 222.548 CNY | 121,51 CNY |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I* NIW | Thesaurierende Klasse EUR I* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)* NIW | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I2 NIW | Thesaurierende Klasse GBP I2 NIW je Anteil |
|-------------------|----------------------------------|--|--|--|----------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | – | – | – | – | 20.687 GBP | 9,51 GBP |
| 31. Dezember 2022 | – | – | – | – | 19.572 GBP | 9,00 GBP |
| 31. Dezember 2021 | 75.956 EUR | 9,49 EUR | 581.939 EUR | 10,39 EUR | 43.285 GBP | 9,69 GBP |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) (nicht währungsgesichert) NIW | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD Z NIW | Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---|---|---------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 704.160 SGD | 13,71 SGD | 3.072.338 USD | 10,27 USD | 48.865.775 USD | 10,14 USD |
| 31. Dezember 2022 | 1.003.087 SGD | 14,69 SGD | 5.761.473 USD | 10,22 USD | 47.003.040 USD | 9,49 USD |
| 31. Dezember 2021 | 3.571.270 SGD | 18,30 SGD | 21.420.695 USD | 11,85 USD | 52.475.111 USD | 10,13 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

China Bond (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD Z (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse USD Z (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|
| 31. Dezember 2023 | 11.943.662 USD | 9,88 USD |
| 31. Dezember 2022 | 11.882.617 USD | 9,78 USD |
| 31. Dezember 2021 | 13.733.211 USD | 11,26 USD |

China Equity

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse CHF I NIW | Thesaurierende Klasse CHF I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR A NIW | Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I NIW | Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 164.919 CHF | 9,11 CHF | 874.281 EUR | 16,18 EUR | 886.658 EUR | 17,69 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 355.994 CHF | 12,23 CHF | 1.489.033 EUR | 21,49 EUR | 1.254.577 EUR | 23,33 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 468.597 CHF | 16,10 CHF | 2.593.043 EUR | 28,39 EUR | 1.813.319 EUR | 30,58 EUR |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR Z NIW | Thesaurierende Klasse EUR Z NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP A NIW | Ausschüttende Klasse GBP A NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP I2 (nicht währungsgesichert)* NIW | Ausschüttende Klasse GBP I2 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|--------------------------------------|--|---|---|
| 31. Dezember 2023 | 12.316 EUR | 13,82 EUR | 10.372 GBP | 8,15 GBP | – | – |
| 31. Dezember 2022 | 16.058 EUR | 18,02 EUR | 13.559 GBP | 10,70 GBP | – | – |
| 31. Dezember 2021 | 20.820 EUR | 23,36 EUR | 226.611 GBP | 13,93 GBP | 276.624 GBP | 28,73 GBP |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

China Equity (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse SGD A NIW | Thesaurierende Klasse SGD A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A NIW | Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD A NIW | Ausschüttende Klasse USD A NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|--------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 1.478.317 SGD | 22,90 SGD | 16.602.580 USD | 19,81 USD | 589.764 USD | 12,15 USD |
| 31. Dezember 2022 | 2.180.349 SGD | 30,18 SGD | 28.844.956 USD | 25,67 USD | 786.778 USD | 15,80 USD |
| 31. Dezember 2021 | 3.238.056 SGD | 39,04 SGD | 49.687.137 USD | 32,88 USD | 1.619.142 USD | 20,24 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I NIW | Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I2 NIW | Thesaurierende Klasse USD I2 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD M NIW | Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|--|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 120.715.813 USD | 21,74 USD | 21.040.703 USD | 13,47 USD | 15.431 USD | 11,38 USD |
| 31. Dezember 2022 | 240.949.106 USD | 27,95 USD | 15.248.435 USD | 17,28 USD | 20.188 USD | 14,88 USD |
| 31. Dezember 2021 | 363.801.495 USD | 35,53 USD | 21.510.739 USD | 21,91 USD | 43.760.360 USD | 19,25 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD U NIW | Thesaurierende Klasse USD U NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD Z NIW | Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 15.726.473 USD | 13,90 USD | 239.524 USD | 14,81 USD |
| 31. Dezember 2022 | 26.266.970 USD | 17,93 USD | 304.598 USD | 18,83 USD |
| 31. Dezember 2021 | 39.927.816 USD | 22,88 USD | 383.001 USD | 23,68 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Climate Innovation¹

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD A* NIW | Thesaurierende Klasse USD A* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I* NIW | Thesaurierende Klasse USD I* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I5* NIW | Thesaurierende Klasse USD I5* NIW je Anteil |
|-------------------|----------------------------------|--|----------------------------------|--|-----------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 9.662 USD | 9,66 USD | 9.696 USD | 9,70 USD | 9.713 USD | 9,71 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD Z* NIW | Thesaurierende Klasse USD Z* NIW je Anteil |
|-------------------|----------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 2.919.017 USD | 9,73 USD |

CLO Income

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR A* NIW | Thesaurierende Klasse EUR A* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I NIW | Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW | Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW je Anteil |
|-------------------|----------------------------------|--|---------------------------------|---|---------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 32.309 EUR | 11,44 EUR | 31.596.103 EUR | 12,20 EUR | 10.206.824 EUR | 8,52 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 62.426 EUR | 9,67 EUR | 11.405.488 EUR | 10,23 EUR | 12.590.646 EUR | 7,90 EUR |
| 31. Dezember 2021 | – | – | 2.024.965 EUR | 11,21 EUR | 14.114.006 EUR | 9,24 EUR |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse GBP I2* NIW | Ausschüttende Klasse GBP I2* NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP I5* NIW | Ausschüttende Klasse GBP I5* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP Z NIW | Thesaurierende Klasse GBP Z NIW je Anteil |
|-------------------|----------------------------------|--|----------------------------------|--|---------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | – | – | – | – | 63.534 GBP | 13,09 GBP |
| 31. Dezember 2022 | 22.140.124 GBP | 8,17 GBP | – | – | 52.625 GBP | 10,84 GBP |
| 31. Dezember 2021 | 30.837.441 GBP | 9,37 GBP | 26.082 GBP | 9,38 GBP | 82.828 GBP | 11,60 GBP |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

CLO Income (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse SEK I NIW | Thesaurierende Klasse SEK I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A* NIW | Thesaurierende Klasse USD A* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I NIW | Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|--|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 30.311.516 SEK | 124,19 SEK | 42.064 USD | 11,87 USD | 58.957.866 USD | 13,62 USD |
| 31. Dezember 2022 | 29.102.703 SEK | 104,04 SEK | 62.292 USD | 9,83 USD | 14.305.878 USD | 11,19 USD |
| 31. Dezember 2021 | 34.950.701 SEK | 113,40 SEK | – | – | 18.681.077 USD | 12,02 USD |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD I* NIW | Ausschüttende Klasse USD I* NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I2 NIW | Ausschüttende Klasse USD I2 NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I5 NIW | Ausschüttende Klasse USD I5 NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 2.616.887 USD | 10,42 USD | 42.131.223 USD | 9,99 USD | 31.820.798 USD | 9,51 USD |
| 31. Dezember 2022 | – | – | 30.076.757 USD | 9,09 USD | 37.889.294 USD | 8,65 USD |
| 31. Dezember 2021 | – | – | 25.769.475 USD | 10,40 USD | 40.735.952 USD | 9,89 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD Z NIW | Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 723.771 USD | 14,15 USD |
| 31. Dezember 2022 | 491.530 USD | 11,53 USD |
| 31. Dezember 2021 | 524.027 USD | 12,30 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Commodities²

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)* | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)* | Thesaurierende Klasse GBP I5* | Thesaurierende Klasse GBP I5* | Thesaurierende Klasse USD A* | Thesaurierende Klasse USD A* |
|-------------------|--|--|----------------------------------|----------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 42.161.474 GBP | 9,20 GBP | 30.032.518 GBP | 8,74 GBP | 1.138.135 USD | 9,00 USD |
| 31. Dezember 2022 | 8.401 GBP | 10,43 GBP | 16.248.150 GBP | 9,42 GBP | 2.916.591 USD | 9,71 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I* | Thesaurierende Klasse USD I* | Thesaurierende Klasse USD I5* | Thesaurierende Klasse USD I5* | Thesaurierende Klasse USD M* | Thesaurierende Klasse USD M* |
|-------------------|---------------------------------|---------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 1.744.147 USD | 10,47 USD | 55.640.585 USD | 9,17 USD | 379.973 USD | 8,21 USD |
| 31. Dezember 2022 | 247.698 USD | 11,20 USD | 59.937.610 USD | 9,78 USD | 432.835 USD | 8,91 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD Z* | Thesaurierende Klasse USD Z* |
|-------------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 2.438.888 USD | 10,65 USD |
| 31. Dezember 2022 | 2.656.009 USD | 11,32 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse CHF P NIW | Thesaurierende Klasse CHF P NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse CHF P NIW | Ausschüttende Klasse CHF P NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---------------------------------------|---|--------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 5.093.356 AUD | 8,02 AUD | 4.766.253 CHF | 10,24 CHF | 1.630.621 CHF | 9,00 CHF |
| 31. Dezember 2022 | 4.816.413 AUD | 7,88 AUD | 22.917.824 CHF | 9,64 CHF | 1.547.416 CHF | 8,79 CHF |
| 31. Dezember 2021 | 9.317.570 AUD | 9,58 AUD | 54.604.181 CHF | 11,27 CHF | 2.871.450 CHF | 10,61 CHF |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR A NIW | Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I NIW | Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 39.329.425 EUR | 8,09 EUR | 150.158.972 EUR | 11,14 EUR | 861.799.950 EUR | 11,96 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 38.403.169 EUR | 7,91 EUR | 124.371.360 EUR | 10,36 EUR | 655.035.193 EUR | 11,06 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 49.140.644 EUR | 9,67 EUR | 181.457.452 EUR | 12,14 EUR | 668.648.608 EUR | 12,88 EUR |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse EUR I NIW | Ausschüttende Klasse EUR I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW | Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW | Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW je Anteil |
|-------------------|--------------------------------------|--|--|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 160.639.032 EUR | 9,38 EUR | 258.577.307 EUR | 11,04 EUR | 54.536.069 EUR | 8,55 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 92.907.803 EUR | 8,98 EUR | 191.477.785 EUR | 10,20 EUR | 177.916.143 EUR | 8,19 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 102.802.041 EUR | 10,80 EUR | 297.187.874 EUR | 11,86 EUR | 177.907.878 EUR | 9,85 EUR |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I3 NIW | Thesaurierende Klasse EUR I3 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW | Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR M NIW | Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|--|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 4.512.654 EUR | 11,16 EUR | 112.450.285 EUR | 12,26 EUR | 11.102.489 EUR | 11,62 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 7.208.715 EUR | 10,30 EUR | 184.534.266 EUR | 11,30 EUR | 11.578.693 EUR | 10,88 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 9.587.464 EUR | 11,97 EUR | 105.834.591 EUR | 13,12 EUR | 12.260.094 EUR | 12,82 EUR |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse EUR M NIW | Ausschüttende Klasse EUR M NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR P NIW | Thesaurierende Klasse EUR P NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR P NIW | Ausschüttende Klasse EUR P NIW je Anteil |
|-------------------|--------------------------------------|--|---------------------------------------|---|--------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 3.338.833 EUR | 7,80 EUR | 8.972.769 EUR | 10,65 EUR | 19.262.572 EUR | 9,41 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 3.553.082 EUR | 7,61 EUR | 37.115.535 EUR | 9,84 EUR | 4.537.698 EUR | 9,02 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 5.282.983 EUR | 9,33 EUR | 172.678.924 EUR | 11,46 EUR | 9.906.904 EUR | 10,84 EUR |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse GBP I NIW | Thesaurierende Klasse GBP I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I2 NIW | Thesaurierende Klasse GBP I2 NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP I2 NIW | Ausschüttende Klasse GBP I2 NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|--|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 2.291.998 GBP | 11,58 GBP | 1.749.168 GBP | 11,42 GBP | 24.129 GBP | 9,64 GBP |
| 31. Dezember 2022 | 5.461.763 GBP | 10,54 GBP | 10.032.613 GBP | 10,38 GBP | 406.601 GBP | 9,09 GBP |
| 31. Dezember 2021 | 7.515.008 GBP | 12,08 GBP | 65.235.151 GBP | 11,88 GBP | 2.229.096 GBP | 10,76 GBP |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse GBP P NIW | Thesaurierende Klasse GBP P NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP P NIW | Ausschüttende Klasse GBP P NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------|---|--------------------------------|--|--|--|
| 31. Dezember 2023 | 1.523.093 GBP | 10,42 GBP | 6.890.614 GBP | 9,32 GBP | 1.755.818 SGD | 16,40 SGD |
| 31. Dezember 2022 | 6.021.069 GBP | 9,48 GBP | 7.470.246 GBP | 8,78 GBP | 1.412.307 SGD | 16,07 SGD |
| 31. Dezember 2021 | 7.982.111 GBP | 10,86 GBP | 5.490.392 GBP | 10,40 GBP | 2.442.580 SGD | 19,43 SGD |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A NIW | Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD A NIW | Ausschüttende Klasse USD A NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---------------------------------|---|--------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 49.232.073 USD | 8,49 USD | 49.383.201 USD | 12,27 USD | 71.151 USD | 8,99 USD |
| 31. Dezember 2022 | 55.263.711 USD | 8,26 USD | 49.003.214 USD | 11,18 USD | 66.746 USD | 8,44 USD |
| 31. Dezember 2021 | 92.010.151 USD | 9,96 USD | 70.561.322 USD | 12,82 USD | 78.523 USD | 9,93 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD C1 NIW | Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I NIW | Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I NIW | Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil |
|-------------------|----------------------------------|--|---------------------------------|---|--------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 3.418.540 USD | 10,50 USD | 47.532.250 USD | 13,63 USD | 980.224 USD | 9,01 USD |
| 31. Dezember 2022 | 5.909.890 USD | 9,66 USD | 54.193.798 USD | 12,35 USD | 1.406.325 USD | 8,45 USD |
| 31. Dezember 2021 | 9.625.219 USD | 11,19 USD | 222.206.104 USD | 14,08 USD | 1.303.331 USD | 9,94 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I2 NIW | Thesaurierende Klasse USD I2 NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I2 NIW | Ausschüttende Klasse USD I2 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD M NIW | Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 5.936.845 USD | 12,74 USD | 5.151.520 USD | 10,31 USD | 7.409.176 USD | 10,76 USD |
| 31. Dezember 2022 | 6.709.367 USD | 11,52 USD | 5.086.148 USD | 9,68 USD | 8.149.257 USD | 9,86 USD |
| 31. Dezember 2021 | 85.047.842 USD | 13,12 USD | 1.422.475 USD | 11,39 USD | 12.021.879 USD | 11,38 USD |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD M NIW | Ausschüttende Klasse USD M NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD P NIW | Thesaurierende Klasse USD P NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD Z NIW | Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil |
|-------------------|--------------------------------------|--|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 2.046.883 USD | 8,60 USD | 7.705.875 USD | 12,14 USD | 443.619 USD | 13,15 USD |
| 31. Dezember 2022 | 2.213.713 USD | 8,23 USD | 15.462.358 USD | 11,00 USD | 399.396 USD | 11,84 USD |
| 31. Dezember 2021 | 2.946.315 USD | 9,87 USD | 67.895.964 USD | 12,54 USD | 224.418 USD | 13,42 USD |

Developed Market FMP – 2027¹

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR A* NIW | Thesaurierende Klasse EUR A* NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR I* NIW | Ausschüttende Klasse EUR I* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A* NIW | Thesaurierende Klasse USD A* NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---------------------------------------|---|--|--|
| 31. Dezember 2023 | 699.973 EUR | 10,31 EUR | 308.247 EUR | 10,38 EUR | 69.482.815 USD | 10,38 USD |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD A* NIW | Ausschüttende Klasse USD A* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I* NIW | Thesaurierende Klasse USD I* NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I* NIW | Ausschüttende Klasse USD I* NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|--|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 27.217.946 USD | 10,38 USD | 977.254 USD | 10,40 USD | 2.182.151 USD | 10,48 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Developed Market FMP – 2027¹ (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD X* | Thesaurierende Klasse USD X* | Ausschüttende Klasse USD X* | Ausschüttende Klasse USD X* |
|-------------------|------------------------------|------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 35.874.119 USD | 10,39 USD | 873.350 USD | 10,39 USD |

Emerging Market Debt – Hard Currency

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse AUD I | Ausschüttende Klasse AUD I | Thesaurierende Klasse CAD I3 (nicht währungsgesichert)* | Thesaurierende Klasse CAD I3 (nicht währungsgesichert)* |
|-------------------|--|--|----------------------------|----------------------------|---|---|
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 1.943.558 AUD | 7,08 AUD | 23.198.262 AUD | 8,31 AUD | 52.703.579 CAD | 12,26 CAD |
| 31. Dezember 2022 | 2.134.881 AUD | 6,88 AUD | 21.672.088 AUD | 7,81 AUD | 47.479.252 CAD | 11,04 CAD |
| 31. Dezember 2021 | 3.086.824 AUD | 9,17 AUD | 31.429.849 AUD | 10,32 AUD | – | – |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse CHF I2 | Thesaurierende Klasse CHF I2 | Thesaurierende Klasse CHF P | Thesaurierende Klasse CHF P | Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) |
|-------------------|------------------------------|------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|--|--|
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 134.304.949 CHF | 8,45 CHF | 25.327.791 CHF | 8,51 CHF | 7.633.978 EUR | 6,33 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 161.496.077 CHF | 7,73 CHF | 21.658.399 CHF | 7,79 CHF | 7.363.041 EUR | 6,20 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 50.748.457 CHF | 9,80 CHF | 35.834.088 CHF | 9,89 CHF | 10.607.100 EUR | 8,36 EUR |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt – Hard Currency (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR A NIW | Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I NIW | Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil |
|-------------------|----------------------------------|--|---|---|---|---|
| 31. Dezember 2023 | 51.163.108 EUR | 10,53 EUR | 89.529.420 EUR | 11,46 EUR | 17.230.269 EUR | 9,70 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 32.580.202 EUR | 9,53 EUR | 118.505.956 EUR | 10,31 EUR | 17.296.623 EUR | 8,82 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 30.854.130 EUR | 12,16 EUR | 346.351.970 EUR | 13,06 EUR | 1.141.580 EUR | 10,22 EUR |
| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse EUR I NIW | Ausschüttende Klasse EUR I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW | Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW | Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 175.147.404 EUR | 6,86 EUR | 45.795.061 EUR | 8,77 EUR | 36.308.806 EUR | 7,36 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 178.942.116 EUR | 6,49 EUR | 61.386.430 EUR | 7,87 EUR | 32.976.153 EUR | 6,96 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 267.762.991 EUR | 8,68 EUR | 100.699.618 EUR | 9,96 EUR | 40.279.528 EUR | 9,32 EUR |
| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I3 NIW | Thesaurierende Klasse EUR I3 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)* NIW | Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR I3* NIW | Ausschüttende Klasse EUR I3* NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 68.995.700 EUR | 9,84 EUR | – | – | – | – |
| 31. Dezember 2022 | 101.186.993 EUR | 8,83 EUR | 29.023.972 EUR | 8,76 EUR | – | – |
| 31. Dezember 2021 | 112.230.449 EUR | 11,16 EUR | 39.028.171 EUR | 10,12 EUR | 2.658.043 EUR | 9,44 EUR |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt – Hard Currency (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I4 NIW | Thesaurierende Klasse EUR I4 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)* NIW | Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR M NIW | Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil |
|-------------------|----------------------------------|--|---|---|---------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 44.153.327 EUR | 11,13 EUR | 89.770.039 EUR | 11,04 EUR | 525.911 EUR | 9,81 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 106.621.915 EUR | 9,97 EUR | 68.627.475 EUR | 10,00 EUR | 625.349 EUR | 8,95 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 172.221.503 EUR | 12,60 EUR | – | – | 880.261 EUR | 11,51 EUR |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse EUR M NIW | Ausschüttende Klasse EUR M NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR P NIW | Thesaurierende Klasse EUR P NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR Z NIW | Thesaurierende Klasse EUR Z NIW je Anteil |
|-------------------|--------------------------------|--|---------------------------------|---|---------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 138.890 EUR | 6,36 EUR | 10.477.004 EUR | 8,88 EUR | 551.473 EUR | 9,27 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 136.677 EUR | 6,16 EUR | 9.665.588 EUR | 7,98 EUR | 298.344 EUR | 8,27 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 234.678 EUR | 8,44 EUR | 42.731.452 EUR | 10,11 EUR | 375.373 EUR | 10,41 EUR |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse GBP I NIW | Thesaurierende Klasse GBP I NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP I NIW | Ausschüttende Klasse GBP I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I2 NIW | Thesaurierende Klasse GBP I2 NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------|---|--------------------------------|--|----------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 14.312.566 GBP | 10,78 GBP | 1.045.922 GBP | 7,41 GBP | 52.006.312 GBP | 9,48 GBP |
| 31. Dezember 2022 | 16.360.366 GBP | 9,55 GBP | 1.864.069 GBP | 6,91 GBP | 31.637.924 GBP | 8,39 GBP |
| 31. Dezember 2021 | 24.108.278 GBP | 11,92 GBP | 7.886.830 GBP | 9,11 GBP | 37.494.529 GBP | 10,45 GBP |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt – Hard Currency (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse GBP I2 NIW | Ausschüttende Klasse GBP I2 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP P NIW | Thesaurierende Klasse GBP P NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|--|--|
| 31. Dezember 2023 | 14.500.268 GBP | 7,71 GBP | 6.285.375 GBP | 9,67 GBP | 1.470.947 HKD | 7,64 HKD |
| 31. Dezember 2022 | 11.800.925 GBP | 7,18 GBP | 7.543.092 GBP | 8,56 GBP | 1.259.413 HKD | 7,38 HKD |
| 31. Dezember 2021 | 17.959.384 GBP | 9,47 GBP | 6.433.590 GBP | 10,68 GBP | 2.284.462 HKD | 9,73 HKD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse JPY I NIW | Thesaurierende Klasse JPY I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse SEK A NIW | Thesaurierende Klasse SEK A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse SEK I (nicht währungsgesichert)* NIW | Thesaurierende Klasse SEK I (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|---|---|
| 31. Dezember 2023 | 1.753.662.260 JPY | 876,83 JPY | 650.472.349 SEK | 101,47 SEK | – | – |
| 31. Dezember 2022 | 1.632.621.347 JPY | 816,31 JPY | 1.276.699.611 SEK | 91,78 SEK | – | – |
| 31. Dezember 2021 | 2.067.191.771 JPY | 1.033,60 JPY | 1.014.308.991 SEK | 116,99 SEK | 315.419 SEK | 105,50 SEK |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse SEK I2 NIW | Thesaurierende Klasse SEK I2 NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|--|--|--|--|
| 31. Dezember 2023 | 66.952.498 SEK | 86,45 SEK | 19.324.573 SGD | 14,34 SGD | 138.241.930 USD | 7,21 USD |
| 31. Dezember 2022 | 135.368.249 SEK | 77,53 SEK | 16.860.018 SGD | 13,92 SGD | 144.691.919 USD | 6,89 USD |
| 31. Dezember 2021 | 261.889.492 SEK | 98,00 SEK | 23.217.536 SGD | 18,39 SGD | 271.875.924 USD | 9,06 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt – Hard Currency (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD A NIW | Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD A NIW | Ausschüttende Klasse USD A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD C1 NIW | Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------|---|--------------------------------|--|----------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 120.778.298 USD | 12,73 USD | 377.098 USD | 8,36 USD | 9.941.291 USD | 9,46 USD |
| 31. Dezember 2022 | 112.403.688 USD | 11,26 USD | 42.552 USD | 7,74 USD | 10.176.824 USD | 8,45 USD |
| 31. Dezember 2021 | 167.936.528 USD | 13,99 USD | 24.437 USD | 10,06 USD | 15.072.281 USD | 10,60 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I NIW | Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I NIW | Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I2 NIW | Thesaurierende Klasse USD I2 NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------|---|--------------------------------|--|----------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 571.487.781 USD | 13,71 USD | 73.431.118 USD | 8,32 USD | 273.160.580 USD | 11,91 USD |
| 31. Dezember 2022 | 583.066.950 USD | 12,04 USD | 80.694.053 USD | 7,70 USD | 33.738.168 USD | 10,45 USD |
| 31. Dezember 2021 | 846.829.107 USD | 14,86 USD | 151.677.969 USD | 10,02 USD | 182.237.940 USD | 12,87 USD |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD I2 NIW | Ausschüttende Klasse USD I2 NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I3 NIW | Ausschüttende Klasse USD I3 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD M NIW | Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------|---|---------------------------------|---|---------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 19.503.916 USD | 8,07 USD | 88.359.188 USD | 8,22 USD | 17.071.508 USD | 9,56 USD |
| 31. Dezember 2022 | 13.108.552 USD | 7,47 USD | 81.371.873 USD | 7,60 USD | 16.134.339 USD | 8,52 USD |
| 31. Dezember 2021 | 28.105.309 USD | 9,71 USD | 103.575.521 USD | 9,89 USD | 23.509.954 USD | 10,67 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt – Hard Currency (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD M NIW | Ausschüttende Klasse USD M NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD P NIW | Thesaurierende Klasse USD P NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD X NIW | Thesaurierende Klasse USD X NIW je Anteil |
|-------------------|-----------------------------------|---|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 3.623.006 USD | 6,75 USD | 62.007.224 USD | 10,19 USD | 112.274.225 USD | 9,30 USD |
| 31. Dezember 2022 | 3.112.446 USD | 6,39 USD | 17.590.354 USD | 8,95 USD | 98.360.925 USD | 8,15 USD |
| 31. Dezember 2021 | 4.183.182 USD | 8,52 USD | 30.611.343 USD | 11,03 USD | 25.072.481 USD | 10,03 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD Z NIW | Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 112.030 USD | 11,49 USD |
| 31. Dezember 2022 | 97.737 USD | 10,02 USD |
| 31. Dezember 2021 | 10.072.039 USD | 12,27 USD |

Emerging Market Debt – Local Currency

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse AUD B NIW | Thesaurierende Klasse AUD B NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)* NIW | Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)* NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|------------------------------------|--|---|---|
| 31. Dezember 2023 | 1.680.905 AUD | 3,51 AUD | 288.975 AUD | 8,34 AUD | – | – |
| 31. Dezember 2022 | 3.579.112 AUD | 3,54 AUD | 279.747 AUD | 7,62 AUD | 67.549 AUD | 3,53 AUD |
| 31. Dezember 2021 | 13.367.215 AUD | 4,65 AUD | 547.824 AUD | 9,06 AUD | 335.367 AUD | 4,64 AUD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt – Local Currency (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse AUD C2 NIW | Thesaurierende Klasse AUD C2 NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse AUD E NIW | Thesaurierende Klasse AUD E NIW je Anteil |
|-------------------|----------------------------------|--|--|--|---------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 7.713 AUD | 8,34 AUD | 508.897 AUD | 3,52 AUD | 68.860 AUD | 8,33 AUD |
| 31. Dezember 2022 | 7.870 AUD | 7,61 AUD | 399.839 AUD | 3,54 AUD | 43.406 AUD | 7,61 AUD |
| 31. Dezember 2021 | 137.972 AUD | 9,05 AUD | 1.991.255 AUD | 4,66 AUD | 67.654 AUD | 9,05 AUD |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse AUD T NIW | Thesaurierende Klasse AUD T NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR A NIW | Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---------------------------------|---|---------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 25.930.999 AUD | 3,82 AUD | 2.144.666 AUD | 9,07 AUD | 1.976.819 EUR | 7,19 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 27.559.985 AUD | 3,81 AUD | 2.188.886 AUD | 8,21 AUD | 2.710.862 EUR | 6,52 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 35.067.739 AUD | 4,97 AUD | 2.587.589 AUD | 9,66 AUD | 25.996.331 EUR | 7,75 EUR |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I NIW | Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------|---|---|---|--|--|
| 31. Dezember 2023 | 26.979.998 EUR | 7,76 EUR | 160.972.265 EUR | 10,15 EUR | 15.466.180 EUR | 11,97 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 12.677.170 EUR | 6,99 EUR | 153.261.974 EUR | 9,22 EUR | 13.077.476 EUR | 10,86 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 30.265.508 EUR | 8,25 EUR | 192.874.499 EUR | 9,93 EUR | 35.836.407 EUR | 11,69 EUR |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt – Local Currency (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)* NIW | Ausschüttende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) NIW | Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)* NIW | Ausschüttende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|--|--|--|--|
| 31. Dezember 2023 | – | – | 19.486.748 EUR | 7,57 EUR | – | – |
| 31. Dezember 2022 | – | – | 18.536.988 EUR | 7,20 EUR | – | – |
| 31. Dezember 2021 | 10.292.044 EUR | 8,91 EUR | 20.906.428 EUR | 8,12 EUR | 238.538 EUR | 7,13 EUR |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR Y (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse EUR Y (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I NIW | Thesaurierende Klasse GBP I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|------------------------------------|--|---|---|
| 31. Dezember 2023 | 78.895.093 EUR | 10,18 EUR | 371.999 GBP | 8,63 GBP | 80.057.410 GBP | 10,42 GBP |
| 31. Dezember 2022 | 79.014.824 EUR | 9,22 EUR | 71.487 GBP | 7,65 GBP | 55.720.554 GBP | 9,67 GBP |
| 31. Dezember 2021 | 97.240.658 EUR | 9,89 EUR | 79.233 GBP | 8,89 GBP | 91.993.396 GBP | 9,83 GBP |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) NIW | Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse SEK A NIW | Thesaurierende Klasse SEK A NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|--|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 40.220.459 GBP | 7,40 GBP | 37.033.049 GBP | 9,95 GBP | 7.555.579 SEK | 88,68 SEK |
| 31. Dezember 2022 | 34.761.741 GBP | 7,20 GBP | 51.131.054 GBP | 9,22 GBP | 8.262.545 SEK | 80,46 SEK |
| 31. Dezember 2021 | 81.473.761 GBP | 7,69 GBP | 115.816.857 GBP | 9,36 GBP | 10.695.289 SEK | 95,54 SEK |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt – Local Currency (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | Thesaurierende Klasse USD A | Thesaurierende Klasse USD A |
|-------------------|---|---|---|---|--------------------------------|--------------------------------|
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 715.536 SGD | 11,03 SGD | 3.826.624 USD | 4,97 USD | 13.576.056 USD | 8,79 USD |
| 31. Dezember 2022 | 431.283 SGD | 10,66 SGD | 2.763.181 USD | 4,73 USD | 13.383.059 USD | 7,78 USD |
| 31. Dezember 2021 | 649.455 SGD | 13,26 SGD | 6.244.240 USD | 5,84 USD | 18.460.479 USD | 8,99 USD |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) | Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) | Thesaurierende Klasse USD B | Thesaurierende Klasse USD B | Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich) | Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich) |
|-------------------|---|---|--------------------------------|--------------------------------|--|--|
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 11.403.018 USD | 4,02 USD | 516.378 USD | 8,91 USD | 3.620 USD | 4,02 USD |
| 31. Dezember 2022 | 11.674.878 USD | 3,97 USD | 507.723 USD | 7,99 USD | 523.171 USD | 3,97 USD |
| 31. Dezember 2021 | 36.742.638 USD | 5,14 USD | 2.532.846 USD | 9,36 USD | 1.870.919 USD | 5,14 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD C2* | Thesaurierende Klasse USD C2* | Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) | Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) | Thesaurierende Klasse USD E | Thesaurierende Klasse USD E |
|-------------------|----------------------------------|----------------------------------|---|---|--------------------------------|--------------------------------|
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | – | – | 1.731.121 USD | 4,02 USD | 259.037 USD | 8,92 USD |
| 31. Dezember 2022 | 22.894 USD | 7,99 USD | 3.285.216 USD | 3,97 USD | 313.230 USD | 7,99 USD |
| 31. Dezember 2021 | 96.102 USD | 9,36 USD | 8.118.705 USD | 5,14 USD | 785.843 USD | 9,36 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt – Local Currency (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) | Thesaurierende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD I | Ausschüttende Klasse USD I | Ausschüttende Klasse USD I |
|-------------------|---|---|--------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 36.107.420 USD | 7,97 USD | 194.371.958 USD | 9,52 USD | 1.184.970 USD | 7,55 USD |
| 31. Dezember 2022 | 39.776.506 USD | 7,52 USD | 373.741.103 USD | 8,36 USD | 537.178 USD | 6,94 USD |
| 31. Dezember 2021 | 70.740.746 USD | 9,23 USD | 471.679.737 USD | 9,60 USD | 16.255.837 USD | 8,34 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I2 | Thesaurierende Klasse USD I2 | Thesaurierende Klasse USD I5 | Thesaurierende Klasse USD I5 | Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) | Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) |
|-------------------|---------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|---|---|
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 70.501.757 USD | 9,26 USD | 16.123 USD | 10,20 USD | 51.105.062 USD | 4,45 USD |
| 31. Dezember 2022 | 54.407.790 USD | 8,12 USD | 18 USD | 9,08 USD | 48.894.990 USD | 4,35 USD |
| 31. Dezember 2021 | 87.839.639 USD | 9,30 USD | 21 USD | 10,74 USD | 57.094.005 USD | 5,58 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD T | Thesaurierende Klasse USD T | Thesaurierende Klasse USD X | Thesaurierende Klasse USD X | Thesaurierende Klasse USD Y | Thesaurierende Klasse USD Y |
|-------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 4.366.661 USD | 9,71 USD | 142.192.091 USD | 9,46 USD | 158.436.161 USD | 9,18 USD |
| 31. Dezember 2022 | 4.066.572 USD | 8,61 USD | 141.579.673 USD | 8,27 USD | 154.229.779 USD | 8,03 USD |
| 31. Dezember 2021 | 3.643.090 USD | 9,99 USD | 158.320.032 USD | 9,45 USD | 185.351.561 USD | 9,18 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt – Local Currency (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse ZAR B NIW | Thesaurierende Klasse ZAR B NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich) NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---------------------------------------|---|---|---|
| 31. Dezember 2023 | 46.066.036 ZAR | 36,52 ZAR | 12.043.264 ZAR | 123,28 ZAR | 68.175 ZAR | 36,53 ZAR |
| 31. Dezember 2022 | 123.706.182 ZAR | 36,58 ZAR | 6.630.951 ZAR | 107,97 ZAR | 2.919.213 ZAR | 36,57 ZAR |
| 31. Dezember 2021 | 372.074.859 ZAR | 47,97 ZAR | 20.592.012 ZAR | 122,85 ZAR | 13.001.826 ZAR | 47,95 ZAR |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse ZAR C2 NIW | Thesaurierende Klasse ZAR C2 NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse ZAR E NIW | Thesaurierende Klasse ZAR E NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|--|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 193.673 ZAR | 121,37 ZAR | 14.044.410 ZAR | 36,52 ZAR | 223.552 ZAR | 123,23 ZAR |
| 31. Dezember 2022 | 99.096 ZAR | 107,97 ZAR | 20.692.248 ZAR | 36,58 ZAR | 790.752 ZAR | 107,98 ZAR |
| 31. Dezember 2021 | 2.369.046 ZAR | 122,83 ZAR | 87.281.421 ZAR | 47,96 ZAR | 3.924.596 ZAR | 122,85 ZAR |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse ZAR T NIW | Thesaurierende Klasse ZAR T NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 562.071.052 ZAR | 39,80 ZAR | 48.967.524 ZAR | 134,35 ZAR |
| 31. Dezember 2022 | 549.054.261 ZAR | 39,47 ZAR | 40.857.889 ZAR | 116,49 ZAR |
| 31. Dezember 2021 | 640.987.979 ZAR | 51,24 ZAR | 35.519.500 ZAR | 131,23 ZAR |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse AUD I3 NIW | Ausschüttende Klasse AUD I3 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR A NIW | Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I NIW | Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 8.072.686 AUD | 7,96 AUD | 10.852.194 EUR | 10,46 EUR | 239.809.262 EUR | 10,81 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 8.275.300 AUD | 7,49 AUD | 10.503.424 EUR | 9,66 EUR | 206.919.548 EUR | 9,92 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 7.443.128 AUD | 8,87 AUD | 8.159.335 EUR | 11,09 EUR | 289.180.614 EUR | 11,31 EUR |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse EUR I NIW | Ausschüttende Klasse EUR I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW | Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW | Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW je Anteil |
|-------------------|-----------------------------------|---|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 23.015.364 EUR | 7,22 EUR | 13.866.675 EUR | 11,12 EUR | 8.681.343 EUR | 7,03 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 24.719.131 EUR | 6,93 EUR | 19.433.459 EUR | 10,19 EUR | 9.667.380 EUR | 6,74 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 39.783.115 EUR | 8,29 EUR | 39.777.757 EUR | 11,60 EUR | 19.021.300 EUR | 8,07 EUR |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse EUR I3 NIW | Ausschüttende Klasse EUR I3 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW | Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|--|--|-------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 37.124.103 EUR | 7,83 EUR | 1.921.897 EUR | 10,67 EUR | 20.761.167 EUR | 11,77 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 22.443 EUR | 7,48 EUR | 579.587 EUR | 9,81 EUR | 21.116.810 EUR | 10,76 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 26.733 EUR | 8,91 EUR | 542.937 EUR | 10,69 EUR | 28.115.162 EUR | 12,22 EUR |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR M NIW | Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR M NIW | Ausschüttende Klasse EUR M NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR Z NIW | Thesaurierende Klasse EUR Z NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------|---|--------------------------------|--|---------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 523.183 EUR | 10,02 EUR | 1.045.469 EUR | 5,99 EUR | 153.104 EUR | 11,70 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 497.438 EUR | 9,32 EUR | 241.149 EUR | 6,05 EUR | 101.072 EUR | 10,65 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 692.926 EUR | 10,79 EUR | 526.771 EUR | 7,54 EUR | 114.450 EUR | 12,06 EUR |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse GBP I NIW | Thesaurierende Klasse GBP I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP I NIW | Ausschüttende Klasse GBP I NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------|---|---|---|--------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 447.473 GBP | 11,57 GBP | 5.642 GBP | 10,53 GBP | 9.742.793 GBP | 8,05 GBP |
| 31. Dezember 2022 | 350.186 GBP | 10,65 GBP | 5.345 GBP | 9,93 GBP | 11.265.349 GBP | 7,75 GBP |
| 31. Dezember 2021 | 560.031 GBP | 11,71 GBP | 81.741.756 GBP | 10,26 GBP | 19.053.387 GBP | 8,95 GBP |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) NIW | Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP P NIW | Thesaurierende Klasse GBP P NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---------------------------------|---|---|---|
| 31. Dezember 2023 | 572.809 GBP | 8,49 GBP | 3.109.393 GBP | 10,14 GBP | 925.166 GBP | 10,44 GBP |
| 31. Dezember 2022 | 560.698 GBP | 8,39 GBP | 6.745.122 GBP | 9,33 GBP | 962.313 GBP | 9,85 GBP |
| 31. Dezember 2021 | 615.334 GBP | 9,09 GBP | 68.691.789 GBP | 10,26 GBP | 1.227.759 GBP | 10,18 GBP |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse GBP Z NIW | Thesaurierende Klasse GBP Z NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse NOK U NIW | Thesaurierende Klasse NOK U NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse SEK A NIW | Thesaurierende Klasse SEK A NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 213.173 GBP | 12,62 GBP | 256.896 NOK | 112,39 NOK | 26.654.232 SEK | 112,47 SEK |
| 31. Dezember 2022 | 194.796 GBP | 11,54 GBP | 228.017 NOK | 99,75 NOK | 27.339.928 SEK | 103,59 SEK |
| 31. Dezember 2021 | 212.772 GBP | 12,60 GBP | 252.567 NOK | 110,49 NOK | 29.175.467 SEK | 114,14 SEK |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A NIW | Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|--|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 4.180.476 SGD | 12,67 SGD | 329.767 USD | 6,55 USD | 6.722.677 USD | 11,69 USD |
| 31. Dezember 2022 | 4.038.162 SGD | 12,31 SGD | 342.321 USD | 6,26 USD | 10.292.897 USD | 10,49 USD |
| 31. Dezember 2021 | 5.096.662 SGD | 15,39 SGD | 479.450 USD | 7,79 USD | 13.236.655 USD | 12,29 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD C1 NIW | Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I NIW | Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I NIW | Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---------------------------------------|---|--------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 826.659 USD | 9,08 USD | 16.801.138 USD | 11,06 USD | 379.773 USD | 8,25 USD |
| 31. Dezember 2022 | 1.059.311 USD | 8,23 USD | 27.687.499 USD | 9,85 USD | 417.314 USD | 7,69 USD |
| 31. Dezember 2021 | 1.352.420 USD | 9,74 USD | 95.215.396 USD | 11,47 USD | 1.720.755 USD | 9,38 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I2* NIW | Thesaurierende Klasse USD I2* NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I2 NIW | Ausschüttende Klasse USD I2 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I3* NIW | Thesaurierende Klasse USD I3* NIW je Anteil |
|-------------------|--------------------------------------|--|------------------------------------|--|--------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | – | – | 40.972.944 USD | 7,57 USD | – | – |
| 31. Dezember 2022 | – | – | 38.999.171 USD | 7,05 USD | 41.113.489 USD | 8,98 USD |
| 31. Dezember 2021 | 10.439 USD | 12,18 USD | 56.056.559 USD | 8,61 USD | 47.739.922 USD | 10,43 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I5* NIW | Thesaurierende Klasse USD I5* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD M NIW | Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD M NIW | Ausschüttende Klasse USD M NIW je Anteil |
|-------------------|--------------------------------------|--|------------------------------------|--|-----------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 33.920.715 USD | 10,40 USD | 731.356 USD | 9,16 USD | 572.534 USD | 6,06 USD |
| 31. Dezember 2022 | – | – | 737.778 USD | 8,29 USD | 486.413 USD | 5,94 USD |
| 31. Dezember 2021 | – | – | 1.152.835 USD | 9,79 USD | 555.953 USD | 7,56 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD Z NIW | Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 125.103 USD | 13,23 USD |
| 31. Dezember 2022 | 110.712 USD | 11,70 USD |
| 31. Dezember 2021 | 143.969 USD | 13,52 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse AUD I2 NIW | Thesaurierende Klasse AUD I2 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse NOK I NIW | Thesaurierende Klasse NOK I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse NOK I3* NIW | Thesaurierende Klasse NOK I3* NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---------------------------------------|---|---|---|
| 31. Dezember 2023 | 23.549.524 AUD | 9,29 AUD | 3.209.047 NOK | 111,71 NOK | 379.560.196 NOK | 103,13 NOK |
| 31. Dezember 2022 | 21.961.420 AUD | 8,67 AUD | 297.517.124 NOK | 103,11 NOK | – | – |
| 31. Dezember 2021 | 25.150.120 AUD | 9,93 AUD | 151.079.339 NOK | 116,42 NOK | – | – |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I NIW | Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I2 NIW | Thesaurierende Klasse USD I2 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD Z NIW | Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|--|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 41.218 USD | 11,20 USD | 4.388.707 USD | 9,34 USD | 6.869.103 USD | 11,26 USD |
| 31. Dezember 2022 | 38.055 USD | 10,34 USD | 4.047.197 USD | 8,61 USD | 5.087.444 USD | 10,33 USD |
| 31. Dezember 2021 | 3.064.011 USD | 12,07 USD | 4.719.304 USD | 10,04 USD | 4.184.553 USD | 11,99 USD |

Emerging Markets Equity

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse AUD B NIW | Thesaurierende Klasse AUD B NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse AUD C2 NIW | Thesaurierende Klasse AUD C2 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse AUD E NIW | Thesaurierende Klasse AUD E NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|--|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 275.609 AUD | 9,42 AUD | 14.841 AUD | 9,43 AUD | 42.510 AUD | 9,41 AUD |
| 31. Dezember 2022 | 389.876 AUD | 9,13 AUD | 11.442 AUD | 9,13 AUD | 125.310 AUD | 9,12 AUD |
| 31. Dezember 2021 | 973.288 AUD | 12,57 AUD | 86.974 AUD | 12,57 AUD | 149.325 AUD | 12,56 AUD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse AUD T NIW | Thesaurierende Klasse AUD T NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse CAD I (nicht währungsgesichert) NIW | Ausschüttende Klasse CAD I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse CAD I2 NIW | Ausschüttende Klasse CAD I2 NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 1.771.385 AUD | 10,11 AUD | 66.826 CAD | 8,07 CAD | 11.897.241 CAD | 7,97 CAD |
| 31. Dezember 2022 | 1.741.416 AUD | 9,69 AUD | 65.215 CAD | 7,87 CAD | 11.406.458 CAD | 7,64 CAD |
| 31. Dezember 2021 | 2.482.029 AUD | 13,22 AUD | 99.440 CAD | 9,67 CAD | 15.162.299 CAD | 10,16 CAD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I NIW | Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR M NIW | Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR Z NIW | Thesaurierende Klasse EUR Z NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------|---|---------------------------------|---|---------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 709.680 EUR | 9,04 EUR | 408.164 EUR | 10,17 EUR | 173.388 EUR | 7,78 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 1.362.334 EUR | 8,60 EUR | 429.393 EUR | 9,87 EUR | 163.271 EUR | 7,33 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 4.453.674 EUR | 11,68 EUR | 638.237 EUR | 13,67 EUR | 219.436 EUR | 9,85 EUR |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse GBP I NIW | Thesaurierende Klasse GBP I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP Z NIW | Thesaurierende Klasse GBP Z NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse JPY I* NIW | Thesaurierende Klasse JPY I* NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------|---|---------------------------------|---|----------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 406.653 GBP | 10,43 GBP | 86.537 GBP | 12,65 GBP | – | – |
| 31. Dezember 2022 | 381.404 GBP | 9,77 GBP | 80.198 GBP | 11,72 GBP | – | – |
| 31. Dezember 2021 | 507.319 GBP | 13,06 GBP | 276.830 GBP | 15,52 GBP | 2.269.318.913 JPY | 1.932,31 JPY |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD A NIW | Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD B NIW | Thesaurierende Klasse USD B NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD C2 NIW | Thesaurierende Klasse USD C2 NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|--|--|
| 31. Dezember 2023 | 5.239.268 USD | 10,08 USD | 856.399 USD | 10,52 USD | 10.153 USD | 10,50 USD |
| 31. Dezember 2022 | 4.825.592 USD | 9,44 USD | 1.423.437 USD | 9,96 USD | 119.565 USD | 9,95 USD |
| 31. Dezember 2021 | 5.958.601 USD | 12,53 USD | 4.387.042 USD | 13,34 USD | 441.938 USD | 13,33 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD E NIW | Thesaurierende Klasse USD E NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I NIW | Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD M NIW | Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 138.219 USD | 10,50 USD | 41.804.429 USD | 11,48 USD | 439.380 USD | 11,20 USD |
| 31. Dezember 2022 | 265.455 USD | 9,94 USD | 155.175.902 USD | 10,66 USD | 398.316 USD | 10,60 USD |
| 31. Dezember 2021 | 259.510 USD | 13,33 USD | 215.496.124 USD | 14,00 USD | 87.899.018 USD | 14,21 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD T NIW | Thesaurierende Klasse USD T NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD Z NIW | Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse ZAR B NIW | Thesaurierende Klasse ZAR B NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 4.026.797 USD | 11,29 USD | 23.862.482 USD | 11,91 USD | 4.948.769 ZAR | 131,03 ZAR |
| 31. Dezember 2022 | 6.120.100 USD | 10,57 USD | 11.172.939 USD | 10,94 USD | 6.247.098 ZAR | 121,51 ZAR |
| 31. Dezember 2021 | 5.000.441 USD | 14,04 USD | 24.331.753 USD | 14,23 USD | 14.496.527 ZAR | 159,43 ZAR |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse ZAR C2 NIW | Thesaurierende Klasse ZAR C2 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse ZAR E NIW | Thesaurierende Klasse ZAR E NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse ZAR T NIW | Thesaurierende Klasse ZAR T NIW je Anteil |
|-------------------|----------------------------------|--|---------------------------------|---|---------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 47.220 ZAR | 131,00 ZAR | 3.798.941 ZAR | 131,02 ZAR | 23.945.169 ZAR | 140,86 ZAR |
| 31. Dezember 2022 | 1.133.518 ZAR | 121,50 ZAR | 3.953.205 ZAR | 121,51 ZAR | 24.141.495 ZAR | 129,33 ZAR |
| 31. Dezember 2021 | 3.248.033 ZAR | 159,42 ZAR | 7.038.741 ZAR | 159,43 ZAR | 27.707.879 ZAR | 168,00 ZAR |

Emerging Markets Select Equity**

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)* NIW | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert)* NIW | Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I* NIW | Thesaurierende Klasse USD I* NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|--|--|----------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | – | – | – | – | – | – |
| 31. Dezember 2022 | 2.008.452 EUR | 8,70 EUR | 1.269.919.529 JPY | 1.112,95 JPY | 81.907.316 USD | 8,84 USD |
| 31. Dezember 2021 | 3.415.822 EUR | 10,88 EUR | 1.481.186.443 JPY | 1.294,74 JPY | 108.356.432 USD | 11,79 USD |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD I* NIW | Ausschüttende Klasse USD I* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I5* NIW | Thesaurierende Klasse USD I5* NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------|---|-----------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | – | – | – | – |
| 31. Dezember 2022 | – | – | 68.263 USD | 8,53 USD |
| 31. Dezember 2021 | 33.280 USD | 11,55 USD | 180.706 USD | 11,33 USD |

** Das Portfolio wurde am 7. September 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Euro Bond

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I NIW | Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR I NIW | Ausschüttende Klasse EUR I NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|--------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 653.118 EUR | 10,95 EUR | 9.919.526 EUR | 10,13 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 78.692 EUR | 9,96 EUR | 9.215.906 EUR | 9,41 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 35.402 EUR | 11,80 EUR | 11.176.195 EUR | 11,42 EUR |

Euro Bond Absolute Return

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I NIW | Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR I NIW | Ausschüttende Klasse EUR I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW | Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|--------------------------------------|--|--|--|
| 31. Dezember 2023 | 1.020.367 EUR | 11,38 EUR | 9.922 EUR | 10,67 EUR | 5.531.035 EUR | 11,43 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 2.262.829 EUR | 10,52 EUR | 13.827.199 EUR | 10,04 EUR | 18.661.626 EUR | 10,55 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 4.281.372 EUR | 11,04 EUR | 14.785.620 EUR | 10,73 EUR | 21.860.412 EUR | 11,04 EUR |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD Z NIW | Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 30.372.279 USD | 12,04 USD |
| 31. Dezember 2022 | 14.615.873 USD | 10,86 USD |
| 31. Dezember 2021 | 14.601.349 USD | 11,11 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

European High Yield Bond

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse CHF I* NIW | Thesaurierende Klasse CHF I* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I NIW | Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR 12* NIW | Thesaurierende Klasse EUR 12* NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|--------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 1.796.679 CHF | 10,75 CHF | 47.206.772 EUR | 14,01 EUR | 208.432 EUR | 10,54 EUR |
| 31. Dezember 2022 | – | – | 875.869 EUR | 12,34 EUR | – | – |
| 31. Dezember 2021 | – | – | 804.681 EUR | 13,64 EUR | – | – |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I5* NIW | Thesaurierende Klasse EUR I5* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR M NIW | Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR X NIW | Thesaurierende Klasse EUR X NIW je Anteil |
|-------------------|--------------------------------------|--|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 6.258.149 EUR | 10,44 EUR | 787.345 EUR | 12,68 EUR | 48.934.376 EUR | 12,33 EUR |
| 31. Dezember 2022 | – | – | 524.711 EUR | 11,31 EUR | 5.239.330 EUR | 10,82 EUR |
| 31. Dezember 2021 | – | – | 468.144 EUR | 12,65 EUR | 5.714.467 EUR | 11,91 EUR |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR Y* NIW | Thesaurierende Klasse EUR Y* NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR Y* NIW | Ausschüttende Klasse EUR Y* NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)* NIW | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)* NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|--|--|
| 31. Dezember 2023 | 281.409.669 EUR | 11,30 EUR | 2.941.098 EUR | 10,74 EUR | – | – |
| 31. Dezember 2022 | – | – | – | – | – | – |
| 31. Dezember 2021 | – | – | – | – | 69.111 SGD | 19,86 SGD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

European High Yield Bond (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse | Ausschüttende Klasse | Thesaurierende | Thesaurierende | Thesaurierende | Thesaurierende |
|-------------------|----------------------|----------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| | USD A (Monatlich) | USD A (Monatlich) | Klasse USD I | Klasse USD I | Klasse USD X | Klasse USD X |
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 320.629 USD | 9,25 USD | 228.440 USD | 16,49 USD | 585.996 USD | 13,90 USD |
| 31. Dezember 2022 | 343.199 USD | 8,63 USD | 14.858.536 USD | 14,23 USD | 2.659.377 USD | 11,95 USD |
| 31. Dezember 2021 | 1.595.734 USD | 9,97 USD | 16.063.101 USD | 15,39 USD | 8.129.396 USD | 12,87 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende | Thesaurierende |
|-------------------|----------------|----------------|
| | Klasse USD Z | Klasse USD Z |
| | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 19.509.577 USD | 13,11 USD |
| 31. Dezember 2022 | 9.687.331 USD | 11,25 USD |
| 31. Dezember 2021 | 10.412.554 USD | 12,09 USD |

European Sustainable Equity

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende | Ausschüttende | Thesaurierende | Thesaurierende | Ausschüttende | Ausschüttende |
|-------------------|---------------|---------------|----------------|----------------|----------------|---------------|
| | Klasse EUR A* | Klasse EUR A* | Klasse EUR I | Klasse EUR I | Klasse EUR I | Klasse EUR I |
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 24.542 EUR | 9,34 EUR | 34.572 EUR | 10,84 EUR | 11.039 EUR | 10,75 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 20.816 EUR | 7,93 EUR | 29.063 EUR | 9,11 EUR | 3.727.608 EUR | 9,09 EUR |
| 31. Dezember 2021 | – | – | 36.335 EUR | 12,14 EUR | 43.048.066 EUR | 12,15 EUR |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

European Sustainable Equity (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse EUR I3 NIW | Ausschüttende Klasse EUR I3 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW | Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR M NIW | Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 112.925.635 EUR | 9,21 EUR | 2.081.086 EUR | 9,49 EUR | 39.633 EUR | 10,33 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 126.435.303 EUR | 7,79 EUR | 1.690.128 EUR | 7,96 EUR | 21.161 EUR | 8,83 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 48.257.250 EUR | 10,37 EUR | 2.114.337 EUR | 10,57 EUR | 28.683 EUR | 11,97 EUR |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR Z NIW | Thesaurierende Klasse EUR Z NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse USD A (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|---|---|---|---|
| 31. Dezember 2023 | 56.967.179 EUR | 10,92 EUR | 9.798 USD | 9,80 USD | 10.041 USD | 10,04 USD |
| 31. Dezember 2022 | 28.841.630 EUR | 9,12 EUR | 8.028 USD | 8,03 USD | 16.077.887 USD | 8,15 USD |
| 31. Dezember 2021 | 321.015 EUR | 12,09 EUR | 11.498 USD | 11,50 USD | 22.830.455 USD | 11,58 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD M (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse USD M (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|
| 31. Dezember 2023 | 9.581 USD | 9,58 USD |
| 31. Dezember 2022 | 7.914 USD | 7,91 USD |
| 31. Dezember 2021 | 11.426 USD | 11,43 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Event Driven²

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I* | Thesaurierende Klasse EUR I* | Thesaurierende Klasse GBP I5* | Thesaurierende Klasse GBP I5* | Ausschüttende Klasse GBP I5* | Ausschüttende Klasse GBP I5* |
|-------------------|------------------------------|------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|------------------------------|------------------------------|
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 9.507 EUR | 10,31 EUR | 75.985.117 GBP | 10,54 GBP | 12.132.056 GBP | 10,55 GBP |
| 31. Dezember 2022 | – | – | 23.956.881 GBP | 10,11 GBP | 26.138 GBP | 10,11 GBP |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse GBP P* | Thesaurierende Klasse GBP P* | Thesaurierende Klasse USD I* | Thesaurierende Klasse USD I* | Thesaurierende Klasse USD I5* | Thesaurierende Klasse USD I5* |
|-------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 27.125 GBP | 10,50 GBP | 10.548 USD | 10,55 USD | 13.846.477 USD | 10,61 USD |
| 31. Dezember 2022 | 26.104 GBP | 10,10 GBP | 10.126.565 USD | 10,12 USD | 2.455.025 USD | 10,13 USD |

Global Bond

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) | Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) | Thesaurierende Klasse EUR I Benchmark Währungsgesicherte Klasse* | Thesaurierende Klasse EUR I Benchmark Währungsgesicherte Klasse* | Thesaurierende Klasse USD C1 | Thesaurierende Klasse USD C1 |
|-------------------|--|--|--|--|------------------------------|------------------------------|
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 29.629 AUD | 7,53 AUD | 28.777 EUR | 10,40 EUR | 340.537 USD | 9,02 USD |
| 31. Dezember 2022 | 29.300 AUD | 7,44 AUD | – | – | 414.949 USD | 8,57 USD |
| 31. Dezember 2021 | 36.285 AUD | 9,22 AUD | – | – | 646.469 USD | 10,29 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Global Bond (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I Benchmark Währungsgesicherte Klasse* | Thesaurierende Klasse USD I Benchmark Währungsgesicherte Klasse* | Thesaurierende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD M | Thesaurierende Klasse USD M |
|-------------------|---|---|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 32.939 USD | 10,98 USD | 3.215.877 USD | 10,26 USD | 420.409 USD | 9,54 USD |
| 31. Dezember 2022 | 30.527 USD | 10,18 USD | 1.427.481 USD | 9,63 USD | 255.883 USD | 9,00 USD |
| 31. Dezember 2021 | – | – | 1.692.881 USD | 11,42 USD | 767.170 USD | 10,76 USD |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) | Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) | Thesaurierende Klasse USD Z | Thesaurierende Klasse USD Z | Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) | Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) |
|-------------------|---|---|--------------------------------|--------------------------------|---|---|
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 23.698 USD | 7,90 USD | 104.673.682 USD | 10,79 USD | 345.130 ZAR | 77,03 ZAR |
| 31. Dezember 2022 | 23.014 USD | 7,67 USD | 132.650.317 USD | 10,10 USD | 338.271 ZAR | 75,50 ZAR |
| 31. Dezember 2021 | 28.145 USD | 9,38 USD | 177.197.847 USD | 11,94 USD | 416.008 ZAR | 92,85 ZAR |

Global Diversified Income FMP – 2024

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR A | Thesaurierende Klasse EUR A | Ausschüttende Klasse EUR A | Ausschüttende Klasse EUR A | Ausschüttende Klasse EUR I | Ausschüttende Klasse EUR I |
|-------------------|--------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 1.220.917 EUR | 9,99 EUR | 223.121 EUR | 8,92 EUR | 881.687 EUR | 8,82 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 1.182.222 EUR | 9,67 EUR | 223.454 EUR | 8,94 EUR | 882.969 EUR | 8,83 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 1.262.238 EUR | 10,33 EUR | 247.602 EUR | 9,90 EUR | 978.540 EUR | 9,79 EUR |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Global Diversified Income FMP – 2024 (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse GBP I NIW | Ausschüttende Klasse GBP I NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse HKD A NIW | Ausschüttende Klasse HKD A NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse SGD A NIW | Ausschüttende Klasse SGD A NIW je Anteil |
|-------------------|--------------------------------------|--|--------------------------------------|--|--------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 1.906.267 GBP | 9,30 GBP | 6.877.059 HKD | 9,17 HKD | 4.402.150 SGD | 18,52 SGD |
| 31. Dezember 2022 | 1.968.485 GBP | 9,16 GBP | 6.811.671 HKD | 9,08 HKD | 4.834.873 SGD | 18,40 SGD |
| 31. Dezember 2021 | 2.146.117 GBP | 9,99 GBP | 7.426.965 HKD | 9,90 HKD | 5.454.504 SGD | 20,00 SGD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD A NIW | Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD A NIW | Ausschüttende Klasse USD A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I NIW | Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|--------------------------------------|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 27.345.677 USD | 10,56 USD | 37.856.568 USD | 9,40 USD | 2.714.197 USD | 10,70 USD |
| 31. Dezember 2022 | 29.538.472 USD | 10,01 USD | 42.245.620 USD | 9,23 USD | 2.564.036 USD | 10,11 USD |
| 31. Dezember 2021 | 35.468.827 USD | 10,47 USD | 50.998.594 USD | 10,00 USD | 4.002.526 USD | 10,53 USD |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD I NIW | Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD X NIW | Thesaurierende Klasse USD X NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD X NIW | Ausschüttende Klasse USD X NIW je Anteil |
|-------------------|--------------------------------------|--|---------------------------------------|---|--------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 2.108.874 USD | 9,41 USD | 22.493.910 USD | 10,69 USD | 54.424.599 USD | 9,41 USD |
| 31. Dezember 2022 | 2.069.152 USD | 9,23 USD | 21.260.082 USD | 10,10 USD | 53.399.383 USD | 9,24 USD |
| 31. Dezember 2021 | 2.441.459 USD | 10,01 USD | 22.155.921 USD | 10,53 USD | 107.962.161 USD | 10,01 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Global Equity Megatrends

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I* NIW | Thesaurierende Klasse EUR I* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)* NIW | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|--|--|---|---|
| 31. Dezember 2023 | 7.537.600 EUR | 9,95 EUR | 7.793.561 EUR | 15,99 EUR | 8.355 GBP | 10,63 GBP |
| 31. Dezember 2022 | – | – | 5.374.723 EUR | 13,68 EUR | – | – |
| 31. Dezember 2021 | – | – | 2.781.561 EUR | 15,15 EUR | – | – |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse SGD A* NIW | Thesaurierende Klasse SGD A* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A NIW | Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD C1 NIW | Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|-------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 41.911 SGD | 20,85 SGD | 43.806.365 USD | 15,15 USD | 3.687.503 USD | 14,33 USD |
| 31. Dezember 2022 | – | – | 33.770.046 USD | 12,43 USD | 3.586.666 USD | 11,87 USD |
| 31. Dezember 2021 | – | – | 33.387.264 USD | 14,54 USD | 4.271.651 USD | 14,03 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I NIW | Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD M NIW | Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD Z* NIW | Thesaurierende Klasse USD Z* NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|-------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 35.156.723 USD | 15,99 USD | 21.892.795 USD | 14,39 USD | 22.954.011 USD | 10,87 USD |
| 31. Dezember 2022 | 9.729.597 USD | 13,01 USD | 17.646.556 USD | 11,90 USD | 8.879.110 USD | 8,77 USD |
| 31. Dezember 2021 | 19.765.635 USD | 15,09 USD | 22.544.188 USD | 14,04 USD | – | – |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Global Flexible Credit Income

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse CAD I5 NIW | Thesaurierende Klasse CAD I5 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I NIW | Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR M NIW | Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 14.626.794 CAD | 10,47 CAD | 5.816.508 EUR | 10,66 EUR | 445.491 EUR | 10,05 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 14.013.104 CAD | 9,34 CAD | 3.643.959 EUR | 9,69 EUR | 390.568 EUR | 9,25 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 15.582.329 CAD | 10,39 CAD | 3.296.205 EUR | 11,01 EUR | 411.798 EUR | 10,67 EUR |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse GBP I5 NIW | Thesaurierende Klasse GBP I5 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A NIW | Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I NIW | Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 151.941.174 GBP | 11,76 GBP | 9.962.495 USD | 10,89 USD | 157.808.987 USD | 11,86 USD |
| 31. Dezember 2022 | 196.137.415 GBP | 10,49 GBP | 9.127.970 USD | 9,74 USD | 123.697.450 USD | 10,54 USD |
| 31. Dezember 2021 | 386.920.465 GBP | 11,70 GBP | 10.681.489 USD | 10,88 USD | 136.359.008 USD | 11,70 USD |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD I NIW | Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD M NIW | Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD Z NIW | Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil |
|-------------------|--------------------------------------|--|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 355.209 USD | 10,15 USD | 6.408.215 USD | 10,60 USD | 6.004.606 USD | 12,11 USD |
| 31. Dezember 2022 | 333.308 USD | 9,53 USD | 5.552.804 USD | 9,56 USD | 5.191.915 USD | 10,70 USD |
| 31. Dezember 2021 | 432.340 USD | 11,09 USD | 6.153.911 USD | 10,76 USD | 10.994.680 USD | 11,81 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Global High Yield SDG Engagement

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse AUD I* | Ausschüttende Klasse AUD I* | Thesaurierende Klasse CHF I4* | Thesaurierende Klasse CHF I4* | Ausschüttende Klasse CHF I4* | Ausschüttende Klasse CHF I4* |
|-------------------|-----------------------------|-----------------------------|-------------------------------|-------------------------------|------------------------------|------------------------------|
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 40.737 AUD | 9,65 AUD | 74.837.938 CHF | 10,11 CHF | 4.796.137 CHF | 9,36 CHF |
| 31. Dezember 2022 | 39.517 AUD | 9,36 AUD | 34.903.208 CHF | 9,53 CHF | 2.109.781 CHF | 9,32 CHF |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse CHF X* | Thesaurierende Klasse CHF X* | Thesaurierende Klasse EUR I4* | Thesaurierende Klasse EUR I4* | Ausschüttende Klasse EUR I4* | Ausschüttende Klasse EUR I4* |
|-------------------|------------------------------|------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|------------------------------|------------------------------|
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 29.298 CHF | 10,00 CHF | 64.352.654 EUR | 10,29 EUR | 1.101.288 EUR | 9,52 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 27.818 CHF | 9,49 CHF | 34.350.965 EUR | 9,51 EUR | 894.723 EUR | 9,30 EUR |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR X* | Thesaurierende Klasse EUR X* | Thesaurierende Klasse EUR Z (PF) | Thesaurierende Klasse EUR Z (PF) | Thesaurierende Klasse GBP I4* | Thesaurierende Klasse GBP I4* |
|-------------------|------------------------------|------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 28.912 EUR | 10,16 EUR | 23.929.260 EUR | 11,58 EUR | 18.172.947 GBP | 10,59 GBP |
| 31. Dezember 2022 | 26.930 EUR | 9,46 EUR | 21.835.394 EUR | 10,68 EUR | 8.029.261 GBP | 9,63 GBP |
| 31. Dezember 2021 | – | – | 24.099.127 EUR | 12,25 EUR | – | – |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Global High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse GBP X* NIW | Thesaurierende Klasse GBP X* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A NIW | Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I NIW | Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 25.092 GBP | 10,46 GBP | 621.460 USD | 12,38 USD | 5.429.150 USD | 13,08 USD |
| 31. Dezember 2022 | 23.001 GBP | 9,59 GBP | 600.599 USD | 11,29 USD | 82.906 USD | 11,86 USD |
| 31. Dezember 2021 | – | – | 878.851 USD | 12,78 USD | 127.787 USD | 13,35 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I4* NIW | Thesaurierende Klasse USD I4* NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD M NIW | Ausschüttende Klasse USD M NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD X NIW | Thesaurierende Klasse USD X NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|--------------------------------------|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 325.223.085 USD | 10,73 USD | 1.251.730 USD | 7,92 USD | 21.053 USD | 10,46 USD |
| 31. Dezember 2022 | 93.240.963 USD | 9,70 USD | 1.212.483 USD | 7,72 USD | 19.180 USD | 9,53 USD |
| 31. Dezember 2021 | – | – | 2.149.362 USD | 9,32 USD | 10.756 USD | 10,76 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD Z NIW | Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 8.991.111 USD | 13,68 USD |
| 31. Dezember 2022 | 8.101.529 USD | 12,32 USD |
| 31. Dezember 2021 | 9.055.187 USD | 13,79 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Global High Yield Sustainable Action**

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I* NIW | Thesaurierende Klasse USD I* NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I* NIW | Ausschüttende Klasse USD I* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD X* NIW | Thesaurierende Klasse USD X* NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|-------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | – | – | – | – | – | – |
| 31. Dezember 2022 | 9.396 USD | 9,40 USD | 12.286.350 USD | 8,43 USD | 9.281 USD | 9,28 USD |
| 31. Dezember 2021 | 10.624 USD | 10,62 USD | 14.496.421 USD | 9,94 USD | 10.453 USD | 10,45 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD Y* NIW | Thesaurierende Klasse USD Y* NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | – | – |
| 31. Dezember 2022 | 2.739.164 USD | 9,13 USD |
| 31. Dezember 2021 | 3.084.210 USD | 10,28 USD |

** Das Portfolio wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

Global Investment Grade Credit

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I* NIW | Thesaurierende Klasse EUR I* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I NIW | Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD X NIW | Thesaurierende Klasse USD X NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 28.687 EUR | 10,51 EUR | 1.777.609 USD | 9,25 USD | 40.267.522 USD | 9,29 USD |
| 31. Dezember 2022 | – | – | 1.224.588 USD | 8,44 USD | 42.337.788 USD | 8,46 USD |
| 31. Dezember 2021 | – | – | 9.876 USD | 9,88 USD | 49.426.204 USD | 9,88 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Global Investment Grade Credit (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD Z NIW | Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 44.688.102 USD | 9,31 USD |
| 31. Dezember 2022 | 42.354.407 USD | 8,47 USD |
| 31. Dezember 2021 | 49.408.813 USD | 9,89 USD |

Global Opportunistic Bond

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I NIW | Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP P NIW | Thesaurierende Klasse GBP P NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A NIW | Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------|---|---------------------------------|---|---------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 14.805 EUR | 9,68 EUR | 22.561 GBP | 9,83 GBP | 20.869 USD | 10,83 USD |
| 31. Dezember 2022 | 8.432.665 EUR | 8,72 EUR | 21.356 GBP | 9,31 GBP | 481.764 USD | 10,22 USD |
| 31. Dezember 2021 | 4.580.004 EUR | 10,08 EUR | 24.292 GBP | 10,59 GBP | 764.522 USD | 11,59 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I NIW | Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I NIW | Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I2 NIW | Thesaurierende Klasse USD I2 NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------|---|--------------------------------|--|----------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 4.553.699 USD | 11,59 USD | 12.262.296 USD | 9,80 USD | 23.293.272 USD | 10,97 USD |
| 31. Dezember 2022 | 4.135.327 USD | 10,91 USD | 8.952.587 USD | 9,50 USD | 24.678.158 USD | 10,32 USD |
| 31. Dezember 2021 | 13.048.644 USD | 12,32 USD | 10.384.711 USD | 11,02 USD | 26.442.006 USD | 11,65 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Global Opportunistic Bond (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD M* NIW | Thesaurierende Klasse USD M* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD Z NIW | Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil |
|-------------------|----------------------------------|--|---------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | – | – | 25.233.838 USD | 10,70 USD |
| 31. Dezember 2022 | – | – | 28.817.657 USD | 10,04 USD |
| 31. Dezember 2021 | 883.229 USD | 10,56 USD | 37.475.394 USD | 11,31 USD |

Global Real Estate Securities

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse EUR I5* NIW | Ausschüttende Klasse EUR I5* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR M NIW | Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil |
|-------------------|----------------------------------|--|---------------------------------|---|---|---|
| 31. Dezember 2023 | – | – | 877.918 EUR | 10,17 EUR | 213.904 EUR | 11,79 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 9.028.171 EUR | 7,69 EUR | 1.021.424 EUR | 9,87 EUR | 103.583 EUR | 11,25 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 8.785.756 EUR | 10,86 EUR | 1.405.014 EUR | 13,96 EUR | 119.721 EUR | 14,07 EUR |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse GBP Z NIW | Thesaurierende Klasse GBP Z NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A NIW | Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD CI NIW | Thesaurierende Klasse USD CI NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------|---|---------------------------------|---|----------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 89.203 GBP | 12,21 GBP | 3.456.439 USD | 10,51 USD | 135.797 USD | 9,28 USD |
| 31. Dezember 2022 | 83.075 GBP | 11,37 GBP | 4.298.698 USD | 9,83 USD | 128.352 USD | 8,77 USD |
| 31. Dezember 2021 | 108.494 GBP | 15,48 GBP | 6.500.961 USD | 13,30 USD | 212.935 USD | 11,98 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Global Real Estate Securities (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I NIW | Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I5 NIW | Ausschüttende Klasse USD I5 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD M NIW | Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 12.394.725 USD | 13,51 USD | 30.861 USD | 9,31 USD | 718.797 USD | 9,51 USD |
| 31. Dezember 2022 | 16.657.145 USD | 12,55 USD | 2.824.490 USD | 8,82 USD | 672.248 USD | 8,99 USD |
| 31. Dezember 2021 | 20.434.205 USD | 16,86 USD | 3.851.557 USD | 12,03 USD | 1.977.571 USD | 12,29 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD Z NIW | Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 2.419.204 USD | 13,89 USD |
| 31. Dezember 2022 | 3.549.409 USD | 12,81 USD |
| 31. Dezember 2021 | 6.105.329 USD | 17,07 USD |

Global Sustainable Equity

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|--|--|--|--|
| 31. Dezember 2023 | 86.892.096 EUR | 12,11 EUR | 78.678 EUR | 11,43 EUR | 1.439.413 EUR | 11,72 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 79.067.463 EUR | 10,10 EUR | 59.173 EUR | 9,73 EUR | 1.214.656 EUR | 9,75 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 111.148.483 EUR | 13,18 EUR | 65.402 EUR | 12,96 EUR | 1.610.088 EUR | 12,68 EUR |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Global Sustainable Equity (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A NIW | Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---|---|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 981.020 GBP | 11,49 GBP | 4.420.169 GBP | 11,59 GBP | 471.447 USD | 8,92 USD |
| 31. Dezember 2022 | 526.524 GBP | 9,85 GBP | 4.009.524 GBP | 9,90 GBP | 523.329 USD | 7,28 USD |
| 31. Dezember 2021 | 8.807 GBP | 12,20 GBP | 8.837 GBP | 12,22 GBP | 39.703 USD | 10,24 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I NIW | Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I NIW | Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD M NIW | Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|-----------------------------------|---|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 11.121.650 USD | 10,93 USD | 12.373 USD | 10,94 USD | 417.625 USD | 10,38 USD |
| 31. Dezember 2022 | 10.623.061 USD | 8,83 USD | 4.393.504 USD | 8,84 USD | 361.394 USD | 8,54 USD |
| 31. Dezember 2021 | 24.053.208 USD | 12,33 USD | 34.904.983 USD | 12,33 USD | 16.681.154 USD | 12,10 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD Z* NIW | Thesaurierende Klasse USD Z* NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 37.957.449 USD | 10,35 USD |
| 31. Dezember 2022 | 24.466.171 USD | 8,32 USD |
| 31. Dezember 2021 | – | – |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Global Sustainable Value

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR M NIW | Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)* NIW | Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)* NIW | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------|---|---|---|--|--|
| 31. Dezember 2023 | 520.510 EUR | 15,76 EUR | 10.307 GBP | 11,12 GBP | 8.811 GBP | 10,70 GBP |
| 31. Dezember 2022 | 483.610 EUR | 14,02 EUR | 9.338 GBP | 10,08 GBP | – | – |
| 31. Dezember 2021 | 628.122 EUR | 16,86 EUR | – | – | – | – |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD A NIW | Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I NIW | Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I3* NIW | Thesaurierende Klasse USD I3* NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------|---|---------------------------------|---|-----------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 1.388.066 USD | 18,39 USD | 10.479.115 USD | 19,50 USD | 31.008.928 USD | 11,06 USD |
| 31. Dezember 2022 | 2.093.493 USD | 15,83 USD | 2.989.730 USD | 16,71 USD | 23.813.624 USD | 9,47 USD |
| 31. Dezember 2021 | 1.133.453 USD | 18,26 USD | 296.605 USD | 19,19 USD | – | – |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD Z NIW | Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 11.985.820 USD | 21,28 USD |
| 31. Dezember 2022 | 19.288.532 USD | 18,15 USD |
| 31. Dezember 2021 | 18.743.661 USD | 20,75 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

High Yield Bond

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse AUD A NIW | Thesaurierende Klasse AUD A NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---------------------------------------|---|--|--|
| 31. Dezember 2023 | 15.862.650 AUD | 6,50 AUD | 2.858.210 AUD | 15,00 AUD | 10.373.440 AUD | 4,93 AUD |
| 31. Dezember 2022 | 18.826.339 AUD | 6,43 AUD | 3.345.436 AUD | 13,78 AUD | 14.918.035 AUD | 4,95 AUD |
| 31. Dezember 2021 | 25.718.582 AUD | 7,91 AUD | 5.613.157 AUD | 15,93 AUD | 28.237.139 AUD | 6,24 AUD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse AUD B NIW | Thesaurierende Klasse AUD B NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich) NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|---|---|--|--|
| 31. Dezember 2023 | 1.011.221 AUD | 9,33 AUD | 3.241 AUD | 4,94 AUD | 1.845.729 AUD | 4,97 AUD |
| 31. Dezember 2022 | 907.067 AUD | 8,71 AUD | 422.009 AUD | 4,96 AUD | 961.233 AUD | 5,00 AUD |
| 31. Dezember 2021 | 1.558.874 AUD | 10,24 AUD | 1.062.589 AUD | 6,25 AUD | 2.851.099 AUD | 6,30 AUD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse AUD E NIW | Thesaurierende Klasse AUD E NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse AUD I NIW | Ausschüttende Klasse AUD I NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|--------------------------------------|--|--|--|
| 31. Dezember 2023 | 413.416 AUD | 10,52 AUD | 17.014.854 AUD | 9,44 AUD | 73.324.379 AUD | 5,74 AUD |
| 31. Dezember 2022 | 394.034 AUD | 9,82 AUD | 24.632.173 AUD | 9,15 AUD | 77.779.276 AUD | 5,71 AUD |
| 31. Dezember 2021 | 2.148.334 AUD | 11,54 AUD | 68.318.695 AUD | 11,10 AUD | 103.756.407 AUD | 7,13 AUD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse AUD T (Wöchentlich) | Ausschüttende Klasse AUD T (Wöchentlich) | Thesaurierende Klasse AUD T | Thesaurierende Klasse AUD T | Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich) |
|-------------------|---|---|--------------------------------|--------------------------------|---|---|
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 754.803 AUD | 5,55 AUD | 1.527.094 AUD | 12,80 AUD | 5.981.498 CAD | 6,74 CAD |
| 31. Dezember 2022 | 790.496 AUD | 5,52 AUD | 2.009.139 AUD | 11,83 AUD | 6.486.618 CAD | 6,61 CAD |
| 31. Dezember 2021 | 1.233.271 AUD | 6,89 AUD | 1.334.710 AUD | 13,75 AUD | 10.968.503 CAD | 8,06 CAD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse CHF A | Thesaurierende Klasse CHF A | Thesaurierende Klasse CHF I | Thesaurierende Klasse CHF I | Thesaurierende Klasse CHF I2 | Thesaurierende Klasse CHF I2 |
|-------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 2.903.144 CHF | 12,18 CHF | 220.795 CHF | 13,06 CHF | 2.436.116 CHF | 11,20 CHF |
| 31. Dezember 2022 | 3.669.718 CHF | 11,47 CHF | 5.277.144 CHF | 12,22 CHF | 1.843.440 CHF | 10,47 CHF |
| 31. Dezember 2021 | 5.323.617 CHF | 13,46 CHF | 678.236 CHF | 14,25 CHF | 2.608.938 CHF | 12,20 CHF |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse CNY I (Monatlich) | Ausschüttende Klasse CNY I (Monatlich) | Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) |
|-------------------|---|---|---|---|---|---|
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 11.540.823 CNY | 73,18 CNY | 208.678 CNY | 77,78 CNY | 5.784.669 EUR | 6,06 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 14.058.980 CNY | 73,25 CNY | 207.631 CNY | 77,39 CNY | 6.420.394 EUR | 6,03 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 18.648.136 CNY | 89,36 CNY | 17.018.798 CNY | 93,83 CNY | 10.909.966 EUR | 7,53 EUR |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR A NIW | Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR A NIW | Ausschüttende Klasse EUR A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I NIW | Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------|---|--------------------------------|--|---------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 5.575.031 EUR | 19,94 EUR | 2.533.501 EUR | 7,19 EUR | 18.413.969 EUR | 17,76 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 20.497.963 EUR | 18,42 EUR | 2.934.472 EUR | 7,01 EUR | 21.263.684 EUR | 16,30 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 29.425.571 EUR | 21,61 EUR | 3.944.868 EUR | 8,62 EUR | 23.795.414 EUR | 19,02 EUR |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse EUR I NIW | Ausschüttende Klasse EUR I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW | Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW | Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW je Anteil |
|-------------------|--------------------------------|--|----------------------------------|--|---------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 4.310.197 EUR | 6,92 EUR | 51.114.447 EUR | 12,47 EUR | 56.865.932 EUR | 6,82 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 5.068.640 EUR | 6,74 EUR | 21.766.293 EUR | 11,44 EUR | 37.930.088 EUR | 6,65 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 12.460.480 EUR | 8,30 EUR | 19.114.240 EUR | 13,33 EUR | 1.155.752 EUR | 8,19 EUR |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I5* NIW | Thesaurierende Klasse EUR I5* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR M NIW | Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR Z NIW | Thesaurierende Klasse EUR Z NIW je Anteil |
|-------------------|-----------------------------------|---|---------------------------------|---|---------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | – | – | 34.119 EUR | 11,15 EUR | 181.078 EUR | 11,90 EUR |
| 31. Dezember 2022 | – | – | 40.548 EUR | 10,36 EUR | 165.274 EUR | 10,87 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 178.350.768 EUR | 10,72 EUR | 36.027 EUR | 12,23 EUR | 191.608 EUR | 12,60 EUR |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse | Ausschüttende Klasse | Thesaurierende | Thesaurierende | Ausschüttende | Ausschüttende |
|-------------------|----------------------|----------------------|----------------|----------------|---------------|---------------|
| | GBP A (Monatlich) | GBP A (Monatlich) | Klasse GBP A | Klasse GBP A | Klasse GBP A | Klasse GBP A |
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 2.684.037 GBP | 6,34 GBP | 1.411.301 GBP | 14,20 GBP | 954.452 GBP | 7,91 GBP |
| 31. Dezember 2022 | 2.614.675 GBP | 6,20 GBP | 1.624.325 GBP | 12,91 GBP | 1.085.076 GBP | 7,59 GBP |
| 31. Dezember 2021 | 5.971.923 GBP | 7,60 GBP | 1.923.551 GBP | 14,87 GBP | 1.639.261 GBP | 9,18 GBP |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende | Thesaurierende | Ausschüttende | Ausschüttende | Thesaurierende | Thesaurierende |
|-------------------|----------------|----------------|----------------|---------------|----------------|----------------|
| | Klasse GBP I | Klasse GBP I | Klasse GBP I | Klasse GBP I | Klasse GBP I2 | Klasse GBP I2 |
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 5.789.389 GBP | 17,29 GBP | 3.395.941 GBP | 8,55 GBP | 1.512.133 GBP | 13,84 GBP |
| 31. Dezember 2022 | 5.660.368 GBP | 15,62 GBP | 7.234.066 GBP | 8,21 GBP | 581.131 GBP | 12,49 GBP |
| 31. Dezember 2021 | 6.489.882 GBP | 17,89 GBP | 16.481.165 GBP | 9,93 GBP | 754.148 GBP | 14,29 GBP |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende | Ausschüttende | Thesaurierende | Thesaurierende | Ausschüttende Klasse | Ausschüttende Klasse |
|-------------------|-----------------|---------------|----------------|----------------|----------------------|----------------------|
| | Klasse GBP I2 | Klasse GBP I2 | Klasse GBP Z | Klasse GBP Z | HKD A (Monatlich) | HKD A (Monatlich) |
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 168.547.845 GBP | 7,57 GBP | 124.386 GBP | 13,42 GBP | 36.563.065 HKD | 6,65 HKD |
| 31. Dezember 2022 | 123.006.920 GBP | 7,27 GBP | 153.131 GBP | 12,06 GBP | 38.478.810 HKD | 6,53 HKD |
| 31. Dezember 2021 | 28.016.548 GBP | 8,79 GBP | 91.103 GBP | 13,72 GBP | 50.388.746 HKD | 7,97 HKD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse SEK A NIW | Thesaurierende Klasse SEK A NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse SGD A NIW | Thesaurierende Klasse SGD A NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 723.938.325 SEK | 136,03 SEK | 19.027.580 SGD | 13,83 SGD | 4.897.409 SGD | 29,01 SGD |
| 31. Dezember 2022 | 78.792.625 SEK | 125,59 SEK | 22.367.741 SGD | 13,65 SGD | 2.875.654 SGD | 26,58 SGD |
| 31. Dezember 2021 | 101.874.300 SEK | 146,45 SEK | 32.504.626 SGD | 16,64 SGD | 3.883.139 SGD | 30,46 SGD |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD A (Wöchentlich) NIW | Ausschüttende Klasse USD A (Wöchentlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A NIW | Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|---|---|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 77.008.320 USD | 7,13 USD | 2.412.509 USD | 6,84 USD | 131.648.685 USD | 18,07 USD |
| 31. Dezember 2022 | 93.381.210 USD | 6,93 USD | 2.844.055 USD | 6,65 USD | 137.066.692 USD | 16,32 USD |
| 31. Dezember 2021 | 160.083.379 USD | 8,42 USD | 2.280.972 USD | 8,07 USD | 201.215.637 USD | 18,63 USD |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD A NIW | Ausschüttende Klasse USD A NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD B NIW | Thesaurierende Klasse USD B NIW je Anteil |
|-------------------|-----------------------------------|---|---|---|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 19.236.817 USD | 8,60 USD | 98.121.371 USD | 5,45 USD | 9.209.516 USD | 11,85 USD |
| 31. Dezember 2022 | 20.742.314 USD | 8,20 USD | 111.013.457 USD | 5,38 USD | 12.754.653 USD | 10,88 USD |
| 31. Dezember 2021 | 35.473.177 USD | 9,80 USD | 173.623.426 USD | 6,70 USD | 20.260.951 USD | 12,61 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD C NIW | Thesaurierende Klasse USD C NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD C1 NIW | Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD C1 NIW | Ausschüttende Klasse USD C1 NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 920.256 USD | 13,28 USD | 2.325.248 USD | 10,80 USD | 595.052 USD | 8,69 USD |
| 31. Dezember 2022 | 894.416 USD | 12,07 USD | 2.598.086 USD | 9,85 USD | 612.205 USD | 8,29 USD |
| 31. Dezember 2021 | 1.176.654 USD | 13,86 USD | 3.629.287 USD | 11,36 USD | 885.749 USD | 9,90 USD |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD C2 NIW | Thesaurierende Klasse USD C2 NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|-------------------------------------|---|---|---|
| 31. Dezember 2023 | 12.549 USD | 5,44 USD | 6.358 USD | 11,86 USD | 10.460.452 USD | 5,53 USD |
| 31. Dezember 2022 | 3.605.063 USD | 5,38 USD | 2.346.023 USD | 10,89 USD | 11.744.149 USD | 5,46 USD |
| 31. Dezember 2021 | 8.209.587 USD | 6,70 USD | 3.518.498 USD | 12,63 USD | 19.267.884 USD | 6,79 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD E NIW | Thesaurierende Klasse USD E NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I NIW | Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 1.547.421 USD | 10,69 USD | 39.896.230 USD | 7,45 USD | 301.321.511 USD | 27,54 USD |
| 31. Dezember 2022 | 2.696.286 USD | 9,81 USD | 56.976.570 USD | 7,20 USD | 420.046.688 USD | 24,73 USD |
| 31. Dezember 2021 | 3.591.490 USD | 11,38 USD | 96.952.330 USD | 8,69 USD | 491.357.430 USD | 28,05 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD I NIW | Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I2 (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse USD I2 (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I2 NIW | Thesaurierende Klasse USD I2 NIW je Anteil |
|-------------------|-----------------------------------|---|--|--|-------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 16.191.311 USD | 9,94 USD | 55.183.017 USD | 8,38 USD | 224.394.250 USD | 15,08 USD |
| 31. Dezember 2022 | 19.820.534 USD | 9,48 USD | 53.570.112 USD | 8,09 USD | 265.106.976 USD | 13,53 USD |
| 31. Dezember 2021 | 50.607.421 USD | 11,34 USD | 71.642.859 USD | 9,76 USD | 421.521.968 USD | 15,33 USD |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD I2 NIW | Ausschüttende Klasse USD I2 NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD M NIW | Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|--|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 220.847.493 USD | 8,30 USD | 140.373.282 USD | 9,42 USD | 460.538 USD | 13,34 USD |
| 31. Dezember 2022 | 156.239.569 USD | 7,91 USD | 124.143.845 USD | 8,88 USD | 553.297 USD | 12,12 USD |
| 31. Dezember 2021 | 101.965.510 USD | 9,46 USD | 190.867.412 USD | 10,56 USD | 685.349 USD | 13,92 USD |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD M NIW | Ausschüttende Klasse USD M NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD P NIW | Thesaurierende Klasse USD P NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) NIW je Anteil |
|-------------------|-----------------------------------|---|------------------------------------|--|---|---|
| 31. Dezember 2023 | 347.894 USD | 8,01 USD | 1.839.803 USD | 11,89 USD | 133.819.218 USD | 6,08 USD |
| 31. Dezember 2022 | 164.387 USD | 7,79 USD | 4.400.603 USD | 10,67 USD | 138.874.267 USD | 5,95 USD |
| 31. Dezember 2021 | 396.356 USD | 9,49 USD | 8.046.885 USD | 12,10 USD | 184.244.304 USD | 7,33 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD T (Wöchentlich) | Ausschüttende Klasse USD T (Wöchentlich) | Thesaurierende Klasse USD T | Thesaurierende Klasse USD T | Ausschüttende Klasse USD U (Monatlich) | Ausschüttende Klasse USD U (Monatlich) |
|-------------------|---|---|--------------------------------|--------------------------------|---|---|
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 1.777.914 USD | 6,12 USD | 10.920.480 USD | 13,23 USD | 753.439 USD | 6,98 USD |
| 31. Dezember 2022 | 1.835.534 USD | 5,99 USD | 7.598.079 USD | 12,02 USD | 742.761 USD | 6,77 USD |
| 31. Dezember 2021 | 2.475.154 USD | 7,37 USD | 9.902.784 USD | 13,80 USD | 899.075 USD | 8,20 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD U | Thesaurierende Klasse USD U | Thesaurierende Klasse USD Z | Thesaurierende Klasse USD Z | Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich) | Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich) |
|-------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|---|---|
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 7.443.249 USD | 14,68 USD | 44.696.204 USD | 14,17 USD | 299.231.482 ZAR | 53,93 ZAR |
| 31. Dezember 2022 | 11.371.297 USD | 13,22 USD | 64.829.210 USD | 12,65 USD | 372.548.933 ZAR | 53,76 ZAR |
| 31. Dezember 2021 | 15.400.385 USD | 15,05 USD | 79.110.967 USD | 14,26 USD | 696.637.863 ZAR | 67,31 ZAR |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich) | Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich) | Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) | Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) | Thesaurierende Klasse ZAR E | Thesaurierende Klasse ZAR E |
|-------------------|--|--|---|---|--------------------------------|--------------------------------|
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 444.980 ZAR | 53,88 ZAR | 77.989.696 ZAR | 53,32 ZAR | 5.270.093 ZAR | 166,67 ZAR |
| 31. Dezember 2022 | 7.199.304 ZAR | 53,71 ZAR | 71.672.740 ZAR | 53,15 ZAR | 9.921.353 ZAR | 148,94 ZAR |
| 31. Dezember 2021 | 20.557.931 ZAR | 67,24 ZAR | 155.721.676 ZAR | 66,55 ZAR | 19.063.973 ZAR | 166,84 ZAR |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse | Ausschüttende Klasse | Thesaurierende | Thesaurierende |
|-------------------|----------------------|----------------------|----------------|----------------|
| | ZAR T (Monatlich) | ZAR T (Monatlich) | Klasse ZAR T | Klasse ZAR T |
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 1.559.123.624 ZAR | 60,27 ZAR | 18.144.180 ZAR | 155,44 ZAR |
| 31. Dezember 2022 | 1.678.189.332 ZAR | 59,48 ZAR | 15.485.308 ZAR | 137,52 ZAR |
| 31. Dezember 2021 | 2.264.598.515 ZAR | 73,73 ZAR | 23.982.306 ZAR | 152,51 ZAR |

InnovAsia 5G

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende | Thesaurierende | Thesaurierende | Thesaurierende | Thesaurierende | Thesaurierende |
|-------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| | Klasse CHF I4 | Klasse CHF I4 | Klasse EUR A | Klasse EUR A | Klasse EUR I4 | Klasse EUR I4 |
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 522.675 CHF | 8,10 CHF | 20.478 EUR | 8,07 EUR | 738.351 EUR | 8,30 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 469.743 CHF | 6,39 CHF | 282.274 EUR | 6,32 EUR | 810.342 EUR | 6,42 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 1.038.996 CHF | 10,86 CHF | 135.730 EUR | 10,82 EUR | 1.024.161 EUR | 10,88 EUR |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende | Thesaurierende | Thesaurierende | Thesaurierende | Thesaurierende | Thesaurierende |
|-------------------|---------------------|---------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| | Klasse EUR M (nicht | Klasse EUR M (nicht | Klasse EUR X | Klasse EUR X | Klasse SGD A | Klasse SGD A |
| | währungsgesichert) | währungsgesichert) | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| | NIW | NIW je Anteil | | | | |
| 31. Dezember 2023 | 36.614 EUR | 9,50 EUR | 4.020.738 EUR | 8,11 EUR | 33.870 SGD | 16,68 SGD |
| 31. Dezember 2022 | 29.209 EUR | 7,58 EUR | 3.134.258 EUR | 6,33 EUR | 26.331 SGD | 12,97 SGD |
| 31. Dezember 2021 | 30.846 EUR | 11,94 EUR | 5.357.398 EUR | 10,83 EUR | 44.171 SGD | 21,75 SGD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

InnovAsia 5G (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse SGD I4 NIW | Thesaurierende Klasse SGD I4 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse SGD X NIW | Thesaurierende Klasse SGD X NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A NIW | Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 1.025.335 SGD | 17,18 SGD | 314.342 SGD | 16,78 SGD | 4.546.493 USD | 8,57 USD |
| 31. Dezember 2022 | 696.450 SGD | 13,20 SGD | 343.196 SGD | 13,02 SGD | 125.519 USD | 6,55 USD |
| 31. Dezember 2021 | 1.144.153 SGD | 21,88 SGD | 573.039 SGD | 21,78 SGD | 274.762 USD | 10,90 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I NIW | Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I4 NIW | Thesaurierende Klasse USD I4 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD M NIW | Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 6.636.583 USD | 8,76 USD | 3.983.343 USD | 8,83 USD | 8.129 USD | 8,13 USD |
| 31. Dezember 2022 | 3.159.260 USD | 6,64 USD | 3.888.909 USD | 6,67 USD | 6.265 USD | 6,26 USD |
| 31. Dezember 2021 | 5.210.923 USD | 10,95 USD | 8.314.820 USD | 10,97 USD | 10.508 USD | 10,51 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD X NIW | Thesaurierende Klasse USD X NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 1.609.703 USD | 8,63 USD |
| 31. Dezember 2022 | 1.765.309 USD | 6,58 USD |
| 31. Dezember 2021 | 3.123.295 USD | 10,92 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Japanischen Aktienengagement

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse EUR I5* NIW | Ausschüttende Klasse EUR I5* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I5 NIW | Thesaurierende Klasse GBP I5 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)* NIW | Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|--|--|
| 31. Dezember 2023 | 31.902 EUR | 11,98 EUR | 344.829 GBP | 10,32 GBP | 11.862.066 GBP | 10,78 GBP |
| 31. Dezember 2022 | 60.111.478 EUR | 9,46 EUR | 321.237 GBP | 8,13 GBP | – | – |
| 31. Dezember 2021 | – | – | 279.974 GBP | 9,34 GBP | – | – |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse JPY I NIW | Thesaurierende Klasse JPY I NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse JPY I NIW | Ausschüttende Klasse JPY I NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|------------------------------------|--|-----------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 11.065.396 GBP | 8,39 GBP | 154.103.501 JPY | 1.742,53 JPY | 23.557.609 JPY | 1.729,24 JPY |
| 31. Dezember 2022 | 17.700 GBP | 7,89 GBP | 503.411.392 JPY | 1.450,08 JPY | 735.824.128 JPY | 1.450,06 JPY |
| 31. Dezember 2021 | 21.052 GBP | 9,39 GBP | 553.780.013 JPY | 1.689,60 JPY | 7.193.678.670 JPY | 1.689,60 JPY |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse JPY I5 NIW | Thesaurierende Klasse JPY I5 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse JPY Z NIW | Thesaurierende Klasse JPY Z NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 8.526.499.141 JPY | 11.320,64 JPY | 3.284.885.177 JPY | 1.117,91 JPY |
| 31. Dezember 2022 | 6.320.326.223 JPY | 9.380,86 JPY | 4.464.613.674 JPY | 922,43 JPY |
| 31. Dezember 2021 | 5.549.922.666 JPY | 10.883,95 JPY | 142.656.638 JPY | 1.065,69 JPY |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Macro Opportunities FX

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I NIW | Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR M* NIW | Thesaurierende Klasse EUR M* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP Z NIW | Thesaurierende Klasse GBP Z NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|--|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 1.264.954 EUR | 9,53 EUR | – | – | 20.546 GBP | 10,25 GBP |
| 31. Dezember 2022 | 1.066.163 EUR | 9,23 EUR | – | – | 162.743 GBP | 9,71 GBP |
| 31. Dezember 2021 | 5.243.651 EUR | 9,47 EUR | 26.625 EUR | 9,68 EUR | 163.106 GBP | 9,73 GBP |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse SEK I NIW | Thesaurierende Klasse SEK I NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse SEK I NIW | Ausschüttende Klasse SEK I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I NIW | Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|--------------------------------------|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 16.510.843 SEK | 96,92 SEK | 37.342 SEK | 100,20 SEK | 11.032 USD | 10,21 USD |
| 31. Dezember 2022 | 263.295.231 SEK | 93,64 SEK | 72.218 SEK | 96,89 SEK | 10.440 USD | 9,66 USD |
| 31. Dezember 2021 | 224.458.577 SEK | 95,49 SEK | 21.475.977 SEK | 98,77 SEK | 10.496 USD | 9,71 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD X* NIW | Thesaurierende Klasse USD X* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD Z NIW | Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | – | – | 83.264 USD | 10,46 USD |
| 31. Dezember 2022 | – | – | 6.993.860 USD | 9,84 USD |
| 31. Dezember 2021 | 12.682.478 USD | 9,80 USD | 4.659.851 USD | 9,84 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Multi-Asset Income**

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I* NIW | Thesaurierende Klasse EUR I* NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP P* NIW | Ausschüttende Klasse GBP P* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A* NIW | Thesaurierende Klasse USD A* NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|-------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | – | – | – | – | – | – |
| 31. Dezember 2022 | – | – | 19.140 GBP | 8,21 GBP | 6.738.767 USD | 10,32 USD |
| 31. Dezember 2021 | 632.450 EUR | 10,95 EUR | 23.306 GBP | 10,00 GBP | 7.690.451 USD | 11,79 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD C1* NIW | Thesaurierende Klasse USD C1* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I* NIW | Thesaurierende Klasse USD I* NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I* NIW | Ausschüttende Klasse USD I* NIW je Anteil |
|-------------------|--------------------------------------|--|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | – | – | – | – | – | – |
| 31. Dezember 2022 | 2.328.953 USD | 9,89 USD | 685.261 USD | 11,59 USD | 107.660 USD | 8,72 USD |
| 31. Dezember 2021 | 3.338.236 USD | 11,40 USD | 1.426.794 USD | 13,15 USD | 230.204 USD | 10,51 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I2* NIW | Thesaurierende Klasse USD I2* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD M* NIW | Thesaurierende Klasse USD M* NIW je Anteil |
|-------------------|--------------------------------------|--|-------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | – | – | – | – |
| 31. Dezember 2022 | – | – | 1.477.940 USD | 10,04 USD |
| 31. Dezember 2021 | 6.841.262 USD | 10,08 USD | 2.435.670 USD | 11,56 USD |

** Das Portfolio wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Next Generation Mobility

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR A NIW | Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I NIW | Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------|---|---------------------------------|---|---|---|
| 31. Dezember 2023 | 159.766 EUR | 14,54 EUR | 41.022 EUR | 10,36 EUR | 39.387.728 EUR | 16,80 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 132.041 EUR | 11,62 EUR | 269.618 EUR | 8,21 EUR | 36.872.226 EUR | 13,43 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 218.365 EUR | 16,56 EUR | 4.751.960 EUR | 11,60 EUR | 43.990.496 EUR | 17,08 EUR |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A NIW | Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD C1 NIW | Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|---------------------------------|---|----------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 34.429.616 EUR | 19,34 EUR | 32.890.078 USD | 16,82 USD | 1.572.905 USD | 17,99 USD |
| 31. Dezember 2022 | 30.152.894 EUR | 15,72 EUR | 26.824.764 USD | 13,10 USD | 1.947.673 USD | 14,16 USD |
| 31. Dezember 2021 | 36.913.115 EUR | 20,33 EUR | 34.030.030 USD | 17,91 USD | 4.295.234 USD | 19,54 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I NIW | Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I NIW | Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD M NIW | Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------|---|--------------------------------|--|---------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 8.977.632 USD | 17,15 USD | 6.463.904 USD | 17,14 USD | 7.433.399 USD | 18,16 USD |
| 31. Dezember 2022 | 4.906.268 USD | 13,25 USD | 5.581.715 USD | 13,24 USD | 7.055.187 USD | 14,25 USD |
| 31. Dezember 2021 | 16.707.928 USD | 17,96 USD | 9.527.770 USD | 17,94 USD | 11.564.452 USD | 19,64 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Next Generation Mobility (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD X NIW | Thesaurierende Klasse USD X NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 25.442.335 USD | 19,90 USD |
| 31. Dezember 2022 | 29.578.839 USD | 15,48 USD |
| 31. Dezember 2021 | 46.685.234 USD | 21,13 USD |

Next Generation Space Economy²

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)* NIW | Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)* NIW | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I* NIW | Thesaurierende Klasse USD I* NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|--|--|----------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 10.045.792 EUR | 11,72 EUR | 4.431.301 EUR | 11,36 EUR | 3.668.583 USD | 12,23 USD |
| 31. Dezember 2022 | 4.206.616 EUR | 9,51 EUR | 1.061.485 EUR | 9,39 EUR | 2.882.343 USD | 9,61 USD |

Responsible Asian Debt – Hard Currency

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A NIW | Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD C1 NIW | Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---------------------------------|---|----------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 259.271 USD | 7,78 USD | 1.198.440 USD | 11,63 USD | 147.067 USD | 9,09 USD |
| 31. Dezember 2022 | 274.934 USD | 7,83 USD | 1.309.918 USD | 10,99 USD | 168.834 USD | 8,68 USD |
| 31. Dezember 2021 | 339.937 USD | 9,54 USD | 2.190.283 USD | 12,77 USD | 414.971 USD | 10,19 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Responsible Asian Debt – Hard Currency (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende | Thesaurierende | Ausschüttende | Ausschüttende | Ausschüttende Klasse | Ausschüttende Klasse |
|-------------------|---------------------|-------------------------------|---------------------|-------------------------------|----------------------------|--------------------------------------|
| | Klasse USD I NIW | Klasse USD I NIW je Anteil | Klasse USD I NIW | Klasse USD I NIW je Anteil | USD I4 (Monatlich)* NIW | USD I4 (Monatlich)* NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 354.813 USD | 12,21 USD | 75.939 USD | 9,21 USD | 10.140 USD | 10,14 USD |
| 31. Dezember 2022 | 344.730 USD | 11,47 USD | 10.492.727 USD | 8,96 USD | 10.118 USD | 10,12 USD |
| 31. Dezember 2021 | 546.459 USD | 13,26 USD | 10.231.270 USD | 10,70 USD | – | – |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende | Thesaurierende | Thesaurierende | Thesaurierende | Ausschüttende Klasse | Ausschüttende Klasse |
|-------------------|-----------------------|---------------------------------|---------------------|-------------------------------|---------------------------|-------------------------------------|
| | Klasse USD I4* NIW | Klasse USD I4* NIW je Anteil | Klasse USD M NIW | Klasse USD M NIW je Anteil | USD X (Monatlich)* NIW | USD X (Monatlich)* NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 10.918 USD | 10,92 USD | 311.342 USD | 9,32 USD | 10.045 USD | 10,05 USD |
| 31. Dezember 2022 | 10.229 USD | 10,23 USD | 490.875 USD | 8,86 USD | 10.098 USD | 10,10 USD |
| 31. Dezember 2021 | – | – | 696.734 USD | 10,36 USD | – | – |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende | Thesaurierende | Thesaurierende | Thesaurierende |
|-------------------|---------------------|-------------------------------|----------------------|--------------------------------|
| | Klasse USD X NIW | Klasse USD X NIW je Anteil | Klasse USD Z* NIW | Klasse USD Z* NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 19.846 USD | 9,05 USD | 61.533.403 USD | 10,72 USD |
| 31. Dezember 2022 | 18.734 USD | 8,54 USD | 8.490.714 USD | 10,01 USD |
| 31. Dezember 2021 | 9.868 USD | 9,87 USD | – | – |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse | Ausschüttende Klasse | Ausschüttende Klasse | Ausschüttende Klasse | Thesaurierende | Thesaurierende |
|-------------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------|----------------|
| | AUD A (Monatlich) | AUD A (Monatlich) | CAD A (Monatlich) | CAD A (Monatlich) | Klasse CHF A | Klasse CHF A |
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 1.587.360 AUD | 7,87 AUD | 418.704 CAD | 8,23 CAD | 3.242.251 CHF | 9,54 CHF |
| 31. Dezember 2022 | 2.610.697 AUD | 7,91 AUD | 4.375.456 CAD | 8,21 CAD | 4.483.337 CHF | 9,23 CHF |
| 31. Dezember 2021 | 2.969.460 AUD | 9,04 AUD | 4.970.148 CAD | 9,33 CAD | 6.727.866 CHF | 10,23 CHF |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende | Ausschüttende | Thesaurierende | Thesaurierende | Ausschüttende | Ausschüttende |
|-------------------|---------------|---------------|----------------|----------------|---------------|---------------|
| | Klasse CHF A | Klasse CHF A | Klasse CHF I | Klasse CHF I | Klasse CHF I | Klasse CHF I |
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 566.322 CHF | 6,80 CHF | 6.601.108 CHF | 10,01 CHF | 725.354 CHF | 6,82 CHF |
| 31. Dezember 2022 | 824.695 CHF | 6,80 CHF | 12.634.709 CHF | 9,64 CHF | 1.149.563 CHF | 6,82 CHF |
| 31. Dezember 2021 | 924.838 CHF | 7,79 CHF | 16.005.206 CHF | 10,63 CHF | 871.394 CHF | 7,82 CHF |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende | Thesaurierende | Ausschüttende | Ausschüttende | Thesaurierende Klasse | Thesaurierende Klasse |
|-------------------|----------------|----------------|----------------|---------------|-----------------------|-----------------------|
| | Klasse CHF I2 | Klasse CHF I2 | Klasse CHF I2 | Klasse CHF I2 | CHF I5 | CHF I5 |
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 10.145.427 CHF | 10,23 CHF | 60.679 CHF | 7,49 CHF | 1.561.093 CHF | 10,44 CHF |
| 31. Dezember 2022 | 19.647.200 CHF | 9,84 CHF | 12.395.410 CHF | 7,49 CHF | 1.515.754 CHF | 10,02 CHF |
| 31. Dezember 2021 | 3.566.030 CHF | 10,84 CHF | 14.461.747 CHF | 8,58 CHF | 4.483.203 CHF | 11,03 CHF |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse CHF P NIW | Thesaurierende Klasse CHF P NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR A NIW | Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR A NIW | Ausschüttende Klasse EUR A NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|--------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 29.312.877 CHF | 9,68 CHF | 104.971.926 EUR | 10,06 EUR | 15.305.883 EUR | 7,18 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 27.905.942 CHF | 9,32 CHF | 117.630.713 EUR | 9,55 EUR | 16.574.105 EUR | 7,04 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 41.732.801 CHF | 10,27 CHF | 166.225.000 EUR | 10,55 EUR | 21.287.062 EUR | 8,05 EUR |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I NIW | Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR I NIW | Ausschüttende Klasse EUR I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW | Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|--------------------------------------|--|--|--|
| 31. Dezember 2023 | 685.080.531 EUR | 10,56 EUR | 154.181.903 EUR | 7,18 EUR | 181.322.110 EUR | 10,65 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 712.003.973 EUR | 9,98 EUR | 163.594.524 EUR | 7,05 EUR | 214.675.538 EUR | 10,06 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 1.145.591.264 EUR | 10,97 EUR | 167.167.694 EUR | 8,05 EUR | 116.405.182 EUR | 11,05 EUR |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW | Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW | Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR M NIW | Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|--|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 52.300.087 EUR | 7,77 EUR | 6.260.518 EUR | 11,07 EUR | 2.460.584 EUR | 9,76 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 59.488.811 EUR | 7,63 EUR | 6.256.930 EUR | 10,43 EUR | 2.699.887 EUR | 9,33 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 14.135.350 EUR | 8,72 EUR | 6.699.994 EUR | 11,44 EUR | 3.298.298 EUR | 10,36 EUR |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse EUR M NIW | Ausschüttende Klasse EUR M NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR P NIW | Thesaurierende Klasse EUR P NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR U NIW | Thesaurierende Klasse EUR U NIW je Anteil |
|-------------------|--------------------------------------|--|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 1.819.533 EUR | 6,80 EUR | 51.801.428 EUR | 10,12 EUR | 2.806.177 EUR | 10,01 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 1.109.542 EUR | 6,79 EUR | 108.476.284 EUR | 9,56 EUR | 3.889.492 EUR | 9,49 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 1.435.772 EUR | 7,89 EUR | 138.193.010 EUR | 10,51 EUR | 5.738.266 EUR | 10,45 EUR |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse EUR X NIW | Ausschüttende Klasse EUR X NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP A NIW | Thesaurierende Klasse GBP A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I NIW | Thesaurierende Klasse GBP I NIW je Anteil |
|-------------------|--------------------------------------|--|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 50.236.839 EUR | 8,97 EUR | 1.023.476 GBP | 10,69 GBP | 2.374.631 GBP | 11,06 GBP |
| 31. Dezember 2022 | 49.291.318 EUR | 8,80 EUR | 1.784.594 GBP | 10,00 GBP | 4.696.255 GBP | 10,30 GBP |
| 31. Dezember 2021 | 56.344.451 EUR | 10,06 EUR | 1.987.812 GBP | 10,87 GBP | 4.507.349 GBP | 11,14 GBP |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse GBP I NIW | Ausschüttende Klasse GBP I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I2 NIW | Thesaurierende Klasse GBP I2 NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP I2 NIW | Ausschüttende Klasse GBP I2 NIW je Anteil |
|-------------------|--------------------------------------|--|--|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 1.563.847 GBP | 8,59 GBP | 470.199 GBP | 11,06 GBP | 11.769.917 GBP | 8,43 GBP |
| 31. Dezember 2022 | 3.745.024 GBP | 8,30 GBP | 2.008.405 GBP | 10,29 GBP | 504.532.899 GBP | 8,15 GBP |
| 31. Dezember 2021 | 5.216.500 GBP | 9,34 GBP | 5.180.160 GBP | 11,12 GBP | 540.540.207 GBP | 9,17 GBP |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse GBP I5 NIW | Ausschüttende Klasse GBP I5 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP P NIW | Thesaurierende Klasse GBP P NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP P* NIW | Ausschüttende Klasse GBP P* NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 143.767.963 GBP | 7,92 GBP | 1.773.074 GBP | 10,39 GBP | – | – |
| 31. Dezember 2022 | 130.424.601 GBP | 7,66 GBP | 1.656.455 GBP | 9,67 GBP | – | – |
| 31. Dezember 2021 | 112.065.803 GBP | 8,62 GBP | 626.791 GBP | 10,45 GBP | 276.207 GBP | 9,69 GBP |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse JPY I NIW | Thesaurierende Klasse JPY I NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse JPY I NIW | Ausschüttende Klasse JPY I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse SEK A NIW | Thesaurierende Klasse SEK A NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|-----------------------------------|---|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 78.935.623.550 JPY | 1.045,62 JPY | 3.877.798.381 JPY | 707,66 JPY | 10.553.645 SEK | 98,35 SEK |
| 31. Dezember 2022 | 90.490.215.829 JPY | 1.024,16 JPY | 3.875.746.192 JPY | 719,95 JPY | 15.573.259 SEK | 93,27 SEK |
| 31. Dezember 2021 | 102.280.856.951 JPY | 1.126,55 JPY | 9.105.341.406 JPY | 824,34 JPY | 25.446.053 SEK | 102,60 SEK |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A NIW | Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|---|---|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 60.789.842 SGD | 16,04 SGD | 28.236.679 USD | 8,26 USD | 359.043.792 USD | 12,14 USD |
| 31. Dezember 2022 | 40.192.701 SGD | 16,13 SGD | 23.230.997 USD | 8,19 USD | 412.842.165 USD | 11,29 USD |
| 31. Dezember 2021 | 39.123.251 SGD | 18,32 SGD | 28.852.590 USD | 9,29 USD | 623.897.960 USD | 12,21 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD A NIW | Ausschüttende Klasse USD A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD C1 NIW | Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD C1 NIW | Ausschüttende Klasse USD C1 NIW je Anteil |
|-------------------|--------------------------------|--|----------------------------------|--|---------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 89.729.509 USD | 8,44 USD | 32.808.938 USD | 10,35 USD | 2.808.791 USD | 8,92 USD |
| 31. Dezember 2022 | 119.519.572 USD | 8,11 USD | 37.919.286 USD | 9,72 USD | 3.929.202 USD | 8,57 USD |
| 31. Dezember 2021 | 193.379.775 USD | 9,07 USD | 56.209.098 USD | 10,62 USD | 5.582.169 USD | 9,58 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I NIW | Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I NIW | Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I2 NIW | Thesaurierende Klasse USD I2 NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------|---|--------------------------------|--|----------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 678.406.064 USD | 12,74 USD | 81.258.937 USD | 8,97 USD | 36.449.926 USD | 12,52 USD |
| 31. Dezember 2022 | 741.407.065 USD | 11,79 USD | 81.356.489 USD | 8,62 USD | 159.773.031 USD | 11,58 USD |
| 31. Dezember 2021 | 1.145.025.152 USD | 12,69 USD | 213.794.766 USD | 9,64 USD | 125.167.562 USD | 12,45 USD |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD I2 NIW | Ausschüttende Klasse USD I2 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I5 NIW | Thesaurierende Klasse USD I5 NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I5 NIW | Ausschüttende Klasse USD I5 NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------|---|----------------------------------|--|---------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 11.897.708 USD | 8,96 USD | 5.068.035 USD | 12,98 USD | 15.103.012 USD | 8,58 USD |
| 31. Dezember 2022 | 88.468.242 USD | 8,61 USD | 5.538.850 USD | 11,98 USD | 21.165.474 USD | 8,25 USD |
| 31. Dezember 2021 | 119.540.024 USD | 9,63 USD | 6.969.453 USD | 12,86 USD | 15.690.435 USD | 9,23 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD M NIW | Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD M NIW | Ausschüttende Klasse USD M NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD P NIW | Thesaurierende Klasse USD P NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|--------------------------------------|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 44.715.996 USD | 10,62 USD | 8.351.328 USD | 8,02 USD | 184.482.252 USD | 12,34 USD |
| 31. Dezember 2022 | 42.163.321 USD | 9,94 USD | 9.583.244 USD | 7,84 USD | 188.567.221 USD | 11,42 USD |
| 31. Dezember 2021 | 53.640.766 USD | 10,82 USD | 9.357.852 USD | 8,92 USD | 204.528.127 USD | 12,29 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD Z NIW | Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 24.595.101 USD | 13,22 USD |
| 31. Dezember 2022 | 14.055.349 USD | 12,18 USD |
| 31. Dezember 2021 | 26.986.290 USD | 13,04 USD |

Short Duration High Yield SDG Engagement

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse CHF A NIW | Thesaurierende Klasse CHF A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse CHF I NIW | Thesaurierende Klasse CHF I NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 1.140.803 AUD | 7,10 AUD | 441.932 CHF | 11,27 CHF | 239.547 CHF | 12,28 CHF |
| 31. Dezember 2022 | 1.192.743 AUD | 7,08 AUD | 790.227 CHF | 10,75 CHF | 227.034 CHF | 11,64 CHF |
| 31. Dezember 2021 | 485.095 AUD | 7,96 AUD | 921.175 CHF | 11,58 CHF | 243.222 CHF | 12,47 CHF |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR A NIW | Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR A NIW | Ausschüttende Klasse EUR A NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---------------------------------------|---|--------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 2.036.218 CNY | 83,39 CNY | 12.464.115 EUR | 12,07 EUR | 1.917.691 EUR | 6,89 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 2.048.761 CNY | 84,25 CNY | 11.761.196 EUR | 11,29 EUR | 2.515.236 EUR | 6,76 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 2.153.866 CNY | 94,05 CNY | 15.735.732 EUR | 12,13 EUR | 2.971.545 EUR | 7,61 EUR |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I NIW | Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW | Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR M NIW | Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|--|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 50.324.368 EUR | 12,94 EUR | 42.272.021 EUR | 12,01 EUR | 976.342 EUR | 10,64 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 39.889.511 EUR | 12,03 EUR | 5.785.967 EUR | 11,15 EUR | 922.543 EUR | 10,01 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 56.858.937 EUR | 12,85 EUR | 1.046.828 EUR | 11,90 EUR | 1.703.444 EUR | 10,82 EUR |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse EUR M NIW | Ausschüttende Klasse EUR M NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I NIW | Thesaurierende Klasse GBP I NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP I NIW | Ausschüttende Klasse GBP I NIW je Anteil |
|-------------------|--------------------------------------|--|---------------------------------------|---|--------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 604.904 EUR | 6,83 EUR | 395.559 GBP | 14,40 GBP | 55.855.459 GBP | 7,80 GBP |
| 31. Dezember 2022 | 630.438 EUR | 6,83 EUR | 15.610.824 GBP | 13,18 GBP | 2.403.578 GBP | 7,53 GBP |
| 31. Dezember 2021 | 673.825 EUR | 7,85 EUR | 17.464.841 GBP | 13,86 GBP | 9.441.941 GBP | 8,37 GBP |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse GBP I2 NIW | Thesaurierende Klasse GBP I2 NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP I2 NIW | Ausschüttende Klasse GBP I2 NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)* NIW | Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)* NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|--|--|
| 31. Dezember 2023 | 1.317.678 GBP | 13,38 GBP | 910.689 GBP | 7,60 GBP | 1.544.860 HKD | 10,06 HKD |
| 31. Dezember 2022 | 1.217.801 GBP | 12,24 GBP | 1.385.249 GBP | 7,34 GBP | 2.368.192 HKD | 9,97 HKD |
| 31. Dezember 2021 | 1.364.744 GBP | 12,86 GBP | 3.963.818 GBP | 8,15 GBP | – | – |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse JPY I NIW | Thesaurierende Klasse JPY I NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse JPY I* NIW | Ausschüttende Klasse JPY I* NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|---|---|
| 31. Dezember 2023 | 16.995.177.792 JPY | 1.250,95 JPY | 1.498.004.233 JPY | 998,67 JPY | 3.611.052 SGD | 14,92 SGD |
| 31. Dezember 2022 | 17.584.604.152 JPY | 1.205,68 JPY | 1.522.033.806 JPY | 1.014,69 JPY | 2.179.241 SGD | 14,86 SGD |
| 31. Dezember 2021 | 18.139.086.488 JPY | 1.288,30 JPY | – | – | 1.330.294 SGD | 16,57 SGD |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A NIW | Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD A NIW | Ausschüttende Klasse USD A NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|------------------------------------|--|-----------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 4.053.791 USD | 7,71 USD | 34.032.810 USD | 14,33 USD | 8.347.581 USD | 8,23 USD |
| 31. Dezember 2022 | 3.099.464 USD | 7,57 USD | 35.220.346 USD | 13,11 USD | 9.519.536 USD | 7,91 USD |
| 31. Dezember 2021 | 4.487.058 USD | 8,41 USD | 39.948.103 USD | 13,77 USD | 9.670.590 USD | 8,70 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD C1 NIW | Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I NIW | Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I NIW | Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil |
|-------------------|----------------------------------|--|---------------------------------|---|--------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 2.836.248 USD | 11,10 USD | 130.562.204 USD | 15,39 USD | 190.980.125 USD | 8,42 USD |
| 31. Dezember 2022 | 3.953.039 USD | 10,26 USD | 121.367.229 USD | 14,00 USD | 2.566.217 USD | 8,09 USD |
| 31. Dezember 2021 | 4.728.605 USD | 10,89 USD | 104.831.003 USD | 14,61 USD | 54.497.667 USD | 8,87 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I2 NIW | Thesaurierende Klasse USD I2 NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I2 NIW | Ausschüttende Klasse USD I2 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I4* NIW | Thesaurierende Klasse USD I4* NIW je Anteil |
|-------------------|----------------------------------|--|---------------------------------|---|-----------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 1.524.302 USD | 14,44 USD | 288.566 USD | 8,22 USD | 2.996.390 USD | 10,66 USD |
| 31. Dezember 2022 | 94.032.462 USD | 13,11 USD | 1.874.619 USD | 7,90 USD | – | – |
| 31. Dezember 2021 | 114.549.884 USD | 13,68 USD | 2.373.346 USD | 8,69 USD | – | – |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I5* NIW | Thesaurierende Klasse USD I5* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD M NIW | Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD M NIW | Ausschüttende Klasse USD M NIW je Anteil |
|-------------------|-----------------------------------|---|---------------------------------|---|--------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 27.842.101 USD | 11,07 USD | 3.127.020 USD | 11,46 USD | 1.580.196 USD | 8,17 USD |
| 31. Dezember 2022 | 25.249.794 USD | 10,04 USD | 8.383.843 USD | 10,55 USD | 3.564.599 USD | 8,00 USD |
| 31. Dezember 2021 | – | – | 3.113.815 USD | 11,15 USD | 1.043.541 USD | 8,97 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD Z NIW | Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 5.677.635 USD | 13,98 USD |
| 31. Dezember 2022 | 9.845.241 USD | 12,64 USD |
| 31. Dezember 2021 | 11.252.560 USD | 13,12 USD |

Strategic Income

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse AUD Z (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse AUD Z (Monatlich) NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)* NIW | Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)* NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|--|--|---|---|
| 31. Dezember 2023 | 63.940.605 AUD | 8,07 AUD | 136.796.522 AUD | 8,80 AUD | 95.409.993 CNY | 100,06 CNY |
| 31. Dezember 2022 | 3.816.128 AUD | 8,10 AUD | 74.440.920 AUD | 8,74 AUD | – | – |
| 31. Dezember 2021 | 5.634.916 AUD | 9,56 AUD | 24.618.870 AUD | 10,22 AUD | – | – |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR A* NIW | Thesaurierende Klasse EUR A* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I NIW | Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|----------------------------------|--|---------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 37.619.121 EUR | 7,50 EUR | 389.376 EUR | 10,64 EUR | 8.449.161 EUR | 11,37 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 6.586.578 EUR | 7,56 EUR | 54.250 EUR | 10,05 EUR | 7.002.752 EUR | 10,68 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 10.163.081 EUR | 9,04 EUR | – | – | 6.916.215 EUR | 12,18 EUR |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Strategic Income (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR M NIW | Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich) NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP I (Monatlich)* NIW | Ausschüttende Klasse GBP I (Monatlich)* NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------|---|--|--|---|---|
| 31. Dezember 2023 | 1.081.589 EUR | 10,37 EUR | 24.369.502 GBP | 8,01 GBP | 6.640.582 GBP | 10,23 GBP |
| 31. Dezember 2022 | 1.332.181 EUR | 9,85 EUR | 1.790.460 GBP | 7,95 GBP | – | – |
| 31. Dezember 2021 | 2.513.964 EUR | 11,36 EUR | 3.137.215 GBP | 9,36 GBP | – | – |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse JPY I NIW | Thesaurierende Klasse JPY I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---------------------------------|---|---|---|
| 31. Dezember 2023 | 722.673.278 HKD | 8,35 HKD | 11.524.159.611 JPY | 1.092,06 JPY | 4.519.951.299 JPY | 1.926,94 JPY |
| 31. Dezember 2022 | 11.395.657 HKD | 8,31 HKD | 12.532.729.742 JPY | 1.065,57 JPY | 3.890.984.078 JPY | 1.656,82 JPY |
| 31. Dezember 2021 | 19.938.038 HKD | 9,76 HKD | 15.036.546.020 JPY | 1.216,93 JPY | 3.786.009.340 JPY | 1.610,18 JPY |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse JPY I CG NIW | Ausschüttende Klasse JPY I CG NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse JPY I NIW | Ausschüttende Klasse JPY I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse JPY Z* NIW | Thesaurierende Klasse JPY Z* NIW je Anteil |
|-------------------|-----------------------------------|---|--------------------------------|--|----------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 1.049.838.759 JPY | 897,38 JPY | 4.233.937 JPY | 798,89 JPY | 5.618.707.917 JPY | 942,88 JPY |
| 31. Dezember 2022 | 5.903.832.844 JPY | 875,62 JPY | 7.335.571.257 JPY | 803,30 JPY | 10.051.163.176 JPY | 915,43 JPY |
| 31. Dezember 2021 | 6.698.942.854 JPY | 1.001,03 JPY | 8.627.434.436 JPY | 944,76 JPY | – | – |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Strategic Income (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse | Ausschüttende Klasse | Thesaurierende Klasse | Thesaurierende | Ausschüttende Klasse | Ausschüttende Klasse |
|-------------------|----------------------|----------------------|-----------------------|----------------|----------------------|----------------------|
| | SGD A (Monatlich) | SGD A (Monatlich) | SGD A | Klasse SGD A | SGD I (Monatlich) | SGD I (Monatlich) |
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 57.886.443 SGD | 15,90 SGD | 13.802.740 SGD | 21,73 SGD | 13.508.509 SGD | 17,77 SGD |
| 31. Dezember 2022 | 22.557.538 SGD | 15,90 SGD | 4.409.893 SGD | 20,36 SGD | 11.455.558 SGD | 17,69 SGD |
| 31. Dezember 2021 | 32.262.797 SGD | 18,64 SGD | 7.722.945 SGD | 22,86 SGD | 7.693.639 SGD | 20,62 SGD |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse | Ausschüttende Klasse | Thesaurierende | Thesaurierende | Ausschüttende | Ausschüttende |
|-------------------|----------------------|----------------------|-----------------|----------------|----------------|---------------|
| | USD A (Monatlich) | USD A (Monatlich) | Klasse USD A | Klasse USD A | Klasse USD A | Klasse USD A |
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 222.806.283 USD | 8,23 USD | 483.593.209 USD | 12,31 USD | 23.776.739 USD | 9,88 USD |
| 31. Dezember 2022 | 39.825.935 USD | 8,11 USD | 302.568.244 USD | 11,37 USD | 15.250.191 USD | 9,39 USD |
| 31. Dezember 2021 | 66.114.445 USD | 9,47 USD | 324.126.174 USD | 12,72 USD | 17.807.491 USD | 10,75 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende | Thesaurierende | Thesaurierende | Thesaurierende | Ausschüttende | Ausschüttende |
|-------------------|----------------|----------------|-----------------|----------------|----------------|---------------|
| | Klasse USD C1 | Klasse USD C1 | Klasse USD I | Klasse USD I | Klasse USD I | Klasse USD I |
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 38.055.662 USD | 10,71 USD | 371.079.167 USD | 13,36 USD | 66.192.394 USD | 9,93 USD |
| 31. Dezember 2022 | 43.957.466 USD | 9,99 USD | 369.131.042 USD | 12,27 USD | 25.395.713 USD | 9,43 USD |
| 31. Dezember 2021 | 74.844.054 USD | 11,29 USD | 410.581.638 USD | 13,67 USD | 26.561.963 USD | 10,80 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Strategic Income (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD M NIW | Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD M NIW | Ausschüttende Klasse USD M NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD Z NIW | Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|-----------------------------------|---|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 111.584.156 USD | 12,23 USD | 10.651.057 USD | 8,54 USD | 46.701.595 USD | 13,55 USD |
| 31. Dezember 2022 | 70.446.108 USD | 11,36 USD | 8.239.009 USD | 8,30 USD | 42.846.054 USD | 12,39 USD |
| 31. Dezember 2021 | 81.107.940 USD | 12,79 USD | 9.575.854 USD | 9,69 USD | 51.445.533 USD | 13,72 USD |

Sustainable Asia High Yield

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR X* NIW | Thesaurierende Klasse EUR X* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP X* NIW | Thesaurierende Klasse GBP X* NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|---|---|
| 31. Dezember 2023 | 363.946 EUR | 8,52 EUR | 37.849 GBP | 9,47 GBP | 19.024 USD | 7,07 USD |
| 31. Dezember 2022 | 3.659.153 EUR | 8,51 EUR | 208.349 GBP | 9,31 GBP | 7.630 USD | 7,63 USD |
| 31. Dezember 2021 | – | – | – | – | 9.897 USD | 9,90 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD A NIW | Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I NIW | Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD Z* NIW | Thesaurierende Klasse USD Z* NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|-------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 8.400 USD | 8,40 USD | 10.423 USD | 8,51 USD | 21.484.485 USD | 8,93 USD |
| 31. Dezember 2022 | 8.284 USD | 8,28 USD | 10.219 USD | 8,34 USD | 20.955.845 USD | 8,70 USD |
| 31. Dezember 2021 | 9.897 USD | 9,90 USD | 24.729.451 USD | 9,90 USD | – | – |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Sustainable Asia High Yield (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD Z* | Ausschüttende Klasse USD Z* |
|-------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 6.587.073 USD | 9,13 USD |
| 31. Dezember 2022 | 6.793.345 USD | 9,42 USD |

Sustainable Emerging Market Corporate Debt

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse CHF I | Thesaurierende Klasse CHF I | Thesaurierende Klasse CHF I4* | Thesaurierende Klasse CHF I4* | Thesaurierende Klasse EUR A | Thesaurierende Klasse EUR A |
|-------------------|--------------------------------|--------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 14.179.749 CHF | 11,37 CHF | – | – | 76.508 EUR | 10,41 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 11.340.526 CHF | 10,96 CHF | 4.061.234 CHF | 8,89 CHF | 630.955 EUR | 9,94 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 27.116.186 CHF | 12,78 CHF | 9.745.025 CHF | 10,33 CHF | 2.490.523 EUR | 11,64 EUR |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR I3 | Thesaurierende Klasse EUR I3 | Thesaurierende Klasse EUR M | Thesaurierende Klasse EUR M |
|-------------------|--------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 321.714 EUR | 12,07 EUR | 234.610 EUR | 10,33 EUR | 544.903 EUR | 9,88 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 525.213 EUR | 11,42 EUR | 236.709 EUR | 9,75 EUR | 533.388 EUR | 9,51 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 636.746 EUR | 13,27 EUR | 364.406 EUR | 11,29 EUR | 690.833 EUR | 11,23 EUR |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Corporate Debt (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse EUR M NIW | Ausschüttende Klasse EUR M NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR X NIW | Thesaurierende Klasse EUR X NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I NIW | Thesaurierende Klasse GBP I NIW je Anteil |
|-------------------|--------------------------------|--|---------------------------------|---|---------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 447.000 EUR | 6,56 EUR | 44.702.260 EUR | 10,99 EUR | 10.422 GBP | 13,25 GBP |
| 31. Dezember 2022 | 383.031 EUR | 6,66 EUR | 42.148.804 EUR | 10,36 EUR | 26.641 GBP | 12,35 GBP |
| 31. Dezember 2021 | 530.868 EUR | 8,30 EUR | 48.759.321 EUR | 11,99 EUR | 134.857 GBP | 14,13 GBP |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse SEK A NIW | Thesaurierende Klasse SEK A NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A NIW | Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 2.108.721 SEK | 91,82 SEK | 689.907 USD | 7,40 USD | 5.070.217 USD | 13,10 USD |
| 31. Dezember 2022 | 2.904.877 SEK | 87,48 SEK | 625.857 USD | 7,32 USD | 6.344.534 USD | 12,24 USD |
| 31. Dezember 2021 | 5.351.492 SEK | 102,06 SEK | 4.027.009 USD | 8,81 USD | 7.973.303 USD | 14,03 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD C1 NIW | Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I NIW | Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I NIW | Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil |
|-------------------|----------------------------------|--|---------------------------------|---|--------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 667.644 USD | 9,88 USD | 18.637.882 USD | 14,24 USD | 2.390.542 USD | 9,07 USD |
| 31. Dezember 2022 | 648.535 USD | 9,32 USD | 20.881.275 USD | 13,20 USD | 2.641.379 USD | 8,77 USD |
| 31. Dezember 2021 | 1.150.929 USD | 10,80 USD | 23.231.127 USD | 15,01 USD | 3.211.502 USD | 10,41 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Corporate Debt (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I2 NIW | Thesaurierende Klasse USD I2 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I5* NIW | Thesaurierende Klasse USD I5* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD M NIW | Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|--------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 515.679 USD | 12,89 USD | – | – | 863.972 USD | 9,95 USD |
| 31. Dezember 2022 | 775.368 USD | 11,93 USD | 338.193 USD | 12,32 USD | 752.825 USD | 9,38 USD |
| 31. Dezember 2021 | 1.015.839 USD | 13,54 USD | 516.979 USD | 13,95 USD | 1.058.465 USD | 10,83 USD |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD M NIW | Ausschüttende Klasse USD M NIW je Anteil |
|-------------------|-----------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 692.358 USD | 7,24 USD |
| 31. Dezember 2022 | 657.453 USD | 7,19 USD |
| 31. Dezember 2021 | 834.074 USD | 8,76 USD |

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency²

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I3* NIW | Thesaurierende Klasse EUR I3* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I4* NIW | Thesaurierende Klasse EUR I4* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I5* NIW | Thesaurierende Klasse EUR I5* NIW je Anteil |
|-------------------|--------------------------------------|--|--------------------------------------|--|--------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 9.353.104 EUR | 11,95 EUR | 252.654.242 EUR | 10,83 EUR | – | – |
| 31. Dezember 2022 | 23.246.658 EUR | 10,79 EUR | – | – | 2.500.773 EUR | 10,01 EUR |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency² (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR X* | Thesaurierende Klasse EUR X* | Thesaurierende Klasse USD I* | Thesaurierende Klasse USD I* | Thesaurierende Klasse USD I5* | Thesaurierende Klasse USD I5* |
|-------------------|---------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 77.767.491 EUR | 9,27 EUR | 9.662 USD | 9,66 USD | 70.543.444 USD | 9,71 USD |
| 31. Dezember 2022 | 64.417.647 EUR | 8,36 EUR | 8.540 USD | 8,54 USD | 62.156.033 USD | 8,55 USD |

Tactical Macro¹

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I* | Thesaurierende Klasse USD I* | Thesaurierende Klasse USD I5* | Thesaurierende Klasse USD I5* | Thesaurierende Klasse USD Z* | Thesaurierende Klasse USD Z* |
|-------------------|---------------------------------|---------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 10.217 USD | 10,22 USD | 336.955 USD | 10,24 USD | 26.721.857 USD | 10,26 USD |

Ultra Short Term Euro Bond

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse CHF P* | Thesaurierende Klasse CHF P* | Thesaurierende Klasse CHF U | Thesaurierende Klasse CHF U | Thesaurierende Klasse EUR A | Thesaurierende Klasse EUR A |
|-------------------|---------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 806.151 CHF | 102,04 CHF | 5.645.975 CHF | 101,34 CHF | 19.721.648 EUR | 100,22 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 770.086 CHF | 97,48 CHF | 6.454.030 CHF | 96,91 CHF | 5.076.654 EUR | 94,09 EUR |
| 31. Dezember 2021 | – | – | 2.120.553 CHF | 102,92 CHF | 8.850.107 EUR | 99,83 EUR |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Ultra Short Term Euro Bond (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I NIW | Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR I NIW | Ausschüttende Klasse EUR I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW | Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|--------------------------------------|--|--|--|
| 31. Dezember 2023 | 611.815.516 EUR | 105,88 EUR | 5.218.533 EUR | 99,85 EUR | 84.236.821 EUR | 104,65 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 504.982.352 EUR | 99,21 EUR | 1.514.355 EUR | 95,44 EUR | 49.163.695 EUR | 98,02 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 706.370.660 EUR | 105,08 EUR | 560.627 EUR | 102,73 EUR | 57.744.254 EUR | 103,78 EUR |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW | Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR M NIW | Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR U NIW | Thesaurierende Klasse EUR U NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 179.474.473 EUR | 106,36 EUR | 8.273.743 EUR | 98,98 EUR | 10.246.656 EUR | 103,96 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 163.327.491 EUR | 99,56 EUR | 75.202 EUR | 93,22 EUR | 3.981.734 EUR | 97,51 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 233.134.238 EUR | 105,34 EUR | 25.116 EUR | 99,50 EUR | 6.150.837 EUR | 103,38 EUR |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR Z NIW | Thesaurierende Klasse EUR Z NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I NIW | Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD Z NIW | Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 2.038.202 EUR | 107,11 EUR | 2.128.401 USD | 104,93 USD | 67.391.984 USD | 117,20 USD |
| 31. Dezember 2022 | 2.239.437 EUR | 100,17 EUR | 2.354.804 USD | 96,33 USD | 86.457.213 USD | 107,40 USD |
| 31. Dezember 2021 | 63.252.625 EUR | 105,86 EUR | 4.003.742 USD | 99,95 USD | 89.530.032 USD | 111,22 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse CHF I NIW | Thesaurierende Klasse CHF I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse CHF I5* NIW | Thesaurierende Klasse CHF I5* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR A NIW | Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|---|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 1.933.894 CHF | 9,07 CHF | – | – | 6.159.807 EUR | 8,94 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 3.430.851 CHF | 10,34 CHF | 1.500.147 CHF | 10,74 CHF | 32.208.149 EUR | 10,07 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 5.076.587 CHF | 9,72 CHF | 472.414 CHF | 10,05 CHF | 53.757.935 EUR | 9,52 EUR |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I NIW | Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW | Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I5* NIW | Thesaurierende Klasse EUR I5* NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|--|--|---|---|
| 31. Dezember 2023 | 9.422.087 EUR | 9,40 EUR | 7.184.374 EUR | 9,72 EUR | – | – |
| 31. Dezember 2022 | 157.192.927 EUR | 10,51 EUR | 15.201.022 EUR | 10,85 EUR | 6.769.918 EUR | 11,01 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 305.145.203 EUR | 9,86 EUR | 12.747.338 EUR | 10,16 EUR | 9.432.020 EUR | 10,29 EUR |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR M NIW | Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR P* NIW | Thesaurierende Klasse EUR P* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I NIW | Thesaurierende Klasse GBP I NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|--|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 658.504 EUR | 8,66 EUR | 202.696 EUR | 8,83 EUR | 13.299.187 GBP | 10,47 GBP |
| 31. Dezember 2022 | 1.654.675 EUR | 9,83 EUR | 28.465.642 EUR | 9,85 EUR | 77.383.312 GBP | 11,52 GBP |
| 31. Dezember 2021 | 572.638 EUR | 9,37 EUR | – | – | 57.830.517 GBP | 10,61 GBP |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse GBP I2 NIW | Thesaurierende Klasse GBP I2 NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP I2* NIW | Ausschüttende Klasse GBP I2* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I5 NIW | Thesaurierende Klasse GBP I5 NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|--|--|--|--|
| 31. Dezember 2023 | 583.156.807 GBP | 10,52 GBP | 262.553 GBP | 9,07 GBP | 33.902.989 GBP | 10,72 GBP |
| 31. Dezember 2022 | 876.636.906 GBP | 11,56 GBP | 76.067 GBP | 9,96 GBP | 244.341.482 GBP | 11,74 GBP |
| 31. Dezember 2021 | 692.453.177 GBP | 10,63 GBP | – | – | 128.525.804 GBP | 10,77 GBP |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse GBP P NIW | Thesaurierende Klasse GBP P NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP Z NIW | Thesaurierende Klasse GBP Z NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse JPY I* NIW | Thesaurierende Klasse JPY I* NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|--|--|
| 31. Dezember 2023 | 349.194.682 GBP | 10,15 GBP | 459.179 GBP | 11,01 GBP | 3.729.880.338 JPY | 887,86 JPY |
| 31. Dezember 2022 | 733.833.769 GBP | 11,16 GBP | 501.313 GBP | 12,02 GBP | 4.336.598.065 JPY | 1.029,89 JPY |
| 31. Dezember 2021 | 463.552.981 GBP | 10,27 GBP | 449.271 GBP | 10,98 GBP | – | – |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse SGD A* NIW | Thesaurierende Klasse SGD A* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A NIW | Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD C1 NIW | Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---------------------------------------|---|--|--|
| 31. Dezember 2023 | 8.864 SGD | 19,35 SGD | 36.187.195 USD | 9,98 USD | 3.919.547 USD | 9,46 USD |
| 31. Dezember 2022 | 201.328 SGD | 20,11 SGD | 76.331.807 USD | 11,03 USD | 7.019.785 USD | 10,57 USD |
| 31. Dezember 2021 | – | – | 37.795.631 USD | 10,26 USD | 8.347.357 USD | 9,92 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I NIW | Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I2 NIW | Thesaurierende Klasse USD I2 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I5 NIW | Thesaurierende Klasse USD I5 NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|--|--|--|--|
| 31. Dezember 2023 | 190.714.139 USD | 10,91 USD | 46.326.710 USD | 10,97 USD | 10.932.246 USD | 11,18 USD |
| 31. Dezember 2022 | 253.706.005 USD | 11,97 USD | 59.598.401 USD | 12,01 USD | 23.473.722 USD | 12,22 USD |
| 31. Dezember 2021 | 160.413.816 USD | 11,05 USD | 70.576.833 USD | 11,07 USD | 17.185.423 USD | 11,24 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD M NIW | Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD P NIW | Thesaurierende Klasse USD P NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD Z NIW | Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 5.177.039 USD | 9,77 USD | 6.768.803 USD | 10,62 USD | 10.835.712 USD | 11,31 USD |
| 31. Dezember 2022 | 14.132.913 USD | 10,89 USD | 54.279.664 USD | 11,66 USD | 27.792.127 USD | 12,32 USD |
| 31. Dezember 2021 | 8.892.322 USD | 10,21 USD | 6.628.186 USD | 10,76 USD | 10.360.938 USD | 11,28 USD |

Uncorrelated Trading^{2**}

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR X* NIW | Thesaurierende Klasse EUR X* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD X* NIW | Thesaurierende Klasse USD X* NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|--|--|
| 31. Dezember 2023 | – | – | – | – |
| 31. Dezember 2022 | 649.030.110 EUR | 9,83 EUR | 18.184.485 USD | 10,00 USD |

** Das Portfolio wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Equity

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse JPY I3* | Thesaurierende Klasse JPY I3* | Thesaurierende Klasse USD A | Thesaurierende Klasse USD A | Thesaurierende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD I |
|-------------------|-------------------------------|-------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 4.044.133.157 JPY | 1.058,06 JPY | 4.099.498 USD | 18,69 USD | 4.648.286 USD | 27,83 USD |
| 31. Dezember 2022 | 2.722.761.830 JPY | 816,04 JPY | 3.127.165 USD | 13,76 USD | 3.063.327 USD | 20,34 USD |
| 31. Dezember 2021 | – | – | 1.156.841 USD | 18,74 USD | 1.524.356 USD | 27,49 USD |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD I | Ausschüttende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD M* | Thesaurierende Klasse USD M* |
|-------------------|----------------------------|----------------------------|------------------------------|------------------------------|
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 6.328.003 USD | 27,62 USD | 5.680.856 USD | 10,43 USD |
| 31. Dezember 2022 | 4.623.317 USD | 20,18 USD | 7.737 USD | 7,74 USD |
| 31. Dezember 2021 | 6.250.342 USD | 27,28 USD | – | – |

US Equity Index PutWrite

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR I | Ausschüttende Klasse EUR I3 | Ausschüttende Klasse EUR I3 | Thesaurierende Klasse EUR I4 | Thesaurierende Klasse EUR I4 |
|-------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|------------------------------|------------------------------|
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 4.043.345 EUR | 13,19 EUR | 5.017.909 EUR | 9,95 EUR | 583.657 EUR | 13,18 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 519.574 EUR | 11,69 EUR | 4.848.784 EUR | 8,83 EUR | 769.301 EUR | 11,65 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 639.232 EUR | 13,45 EUR | 2.284.710 EUR | 10,38 EUR | 2.418.683 EUR | 13,37 EUR |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Equity Index PutWrite (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse EUR I4* NIW | Ausschüttende Klasse EUR I4* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR M NIW | Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|--|--|
| 31. Dezember 2023 | 27.686 EUR | 10,07 EUR | 307.642 EUR | 11,98 EUR | 15.677.985 GBP | 14,79 GBP |
| 31. Dezember 2022 | – | – | 295.878 EUR | 10,76 EUR | 32.974.906 GBP | 13,58 GBP |
| 31. Dezember 2021 | – | – | 425.718 EUR | 12,56 EUR | 24.332.662 GBP | 13,50 GBP |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse GBP I3 NIW | Thesaurierende Klasse GBP I3 NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP I3 NIW | Ausschüttende Klasse GBP I3 NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)* NIW | Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|---|---|
| 31. Dezember 2023 | 112.770.545 GBP | 12,63 GBP | 243.278.811 GBP | 10,76 GBP | 8.228 GBP | 10,48 GBP |
| 31. Dezember 2022 | 72.609.172 GBP | 11,58 GBP | 199.939.675 GBP | 9,40 GBP | – | – |
| 31. Dezember 2021 | 25.831.312 GBP | 11,49 GBP | 34.793.614 GBP | 10,90 GBP | – | – |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse GBP I4* NIW | Thesaurierende Klasse GBP I4* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP I4* NIW | Ausschüttende Klasse GBP I4* NIW je Anteil |
|-------------------|--------------------------------------|--|---|---|-------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | – | – | 56.296.882 GBP | 15,33 GBP | 443.810 GBP | 10,24 GBP |
| 31. Dezember 2022 | – | – | 131.866.462 GBP | 14,05 GBP | – | – |
| 31. Dezember 2021 | 11.732 GBP | 13,86 GBP | 124.042.500 GBP | 13,93 GBP | 9.485 GBP | 12,05 GBP |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Equity Index PutWrite (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) NIW | Ausschüttende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A NIW | Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|---|---|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 3.959.945 GBP | 10,53 GBP | 191.141 SGD | 20,38 SGD | 13.352.314 USD | 14,98 USD |
| 31. Dezember 2022 | 4.612.426 GBP | 10,06 GBP | 182.949 SGD | 18,85 SGD | 12.416.490 USD | 13,06 USD |
| 31. Dezember 2021 | 2.986.073 GBP | 10,40 GBP | 226.127 SGD | 22,21 SGD | 13.407.217 USD | 14,70 USD |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I NIW | Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I3* NIW | Thesaurierende Klasse USD I3* NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|------------------------------------|--|--------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 10.367 USD | 11,64 USD | 69.249.366 USD | 15,82 USD | – | – |
| 31. Dezember 2022 | 11.585.856 USD | 10,55 USD | 55.168.614 USD | 13,71 USD | – | – |
| 31. Dezember 2021 | 13.863.352 USD | 12,29 USD | 69.629.787 USD | 15,34 USD | 11.565 USD | 13,62 USD |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD I3 NIW | Ausschüttende Klasse USD I3 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I4 NIW | Thesaurierende Klasse USD I4 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD M NIW | Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 24.031.846 USD | 10,47 USD | 5.805.985 USD | 15,37 USD | 1.228.399 USD | 14,02 USD |
| 31. Dezember 2022 | 18.562.430 USD | 9,09 USD | 5.127.891 USD | 13,29 USD | 1.208.956 USD | 12,32 USD |
| 31. Dezember 2021 | 10.941.666 USD | 10,39 USD | 27.897.131 USD | 14,84 USD | 1.500.582 USD | 13,98 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Equity Index PutWrite (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD Z NIW | Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 52.893.166 USD | 16,10 USD |
| 31. Dezember 2022 | 37.615.063 USD | 13,87 USD |
| 31. Dezember 2021 | 44.044.794 USD | 15,43 USD |

US Large Cap Value

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR A* NIW | Thesaurierende Klasse EUR A* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)* NIW | Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I* NIW | Thesaurierende Klasse EUR I* NIW je Anteil |
|-------------------|----------------------------------|--|--|--|----------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 584.267 EUR | 10,25 EUR | 234.125 EUR | 9,96 EUR | 25.517.697 EUR | 8,75 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 151.717 EUR | 10,87 EUR | 421.987 EUR | 10,68 EUR | 13.504.321 EUR | 9,20 EUR |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)* NIW | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)* NIW | Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)* NIW | Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|--|--|---|---|
| 31. Dezember 2023 | 146.699.614 EUR | 8,86 EUR | 11.657.942 EUR | 9,26 EUR | 104.079.203 EUR | 9,84 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 37.390.049 EUR | 9,42 EUR | 14.242.602 EUR | 9,91 EUR | 117.300.158 EUR | 10,42 EUR |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Large Cap Value (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse GBP I* NIW | Thesaurierende Klasse GBP I* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)* NIW | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP I* NIW | Ausschüttende Klasse GBP I* NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---|---|---|---|
| 31. Dezember 2023 | 23.832 GBP | 9,43 GBP | 462.887 GBP | 8,88 GBP | 299.756 GBP | 9,42 GBP |
| 31. Dezember 2022 | 24.659 GBP | 9,76 GBP | 8.138 GBP | 9,66 GBP | 24.659 GBP | 9,76 GBP |
| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)* NIW | Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)* NIW | Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)* NIW | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 5.459.927 GBP | 8,86 GBP | 713.712.896 GBP | 9,96 GBP | 1.510.453 GBP | 9,44 GBP |
| 31. Dezember 2022 | 8.138 GBP | 9,66 GBP | 767.350.829 GBP | 10,92 GBP | 1.047.402 GBP | 10,28 GBP |
| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse GBP P* NIW | Ausschüttende Klasse GBP P* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)* NIW | Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)* NIW | Ausschüttende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 27.450 GBP | 10,25 GBP | 96.933.670 GBP | 9,63 GBP | 289.665 GBP | 9,43 GBP |
| 31. Dezember 2022 | 28.455 GBP | 10,63 GBP | 79.855.605 GBP | 10,48 GBP | 57.641 GBP | 10,29 GBP |
| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD A* NIW | Thesaurierende Klasse USD A* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I NIW | Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I4* NIW | Ausschüttende Klasse USD I4* NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 64.226.695 USD | 9,18 USD | 348.767.232 USD | 10,01 USD | 42.162.635 USD | 9,31 USD |
| 31. Dezember 2022 | 64.127.333 USD | 9,50 USD | 370.024.843 USD | 10,28 USD | 55.448.399 USD | 9,63 USD |
| 31. Dezember 2021 | – | – | 2.078.974 USD | 10,39 USD | – | – |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Large Cap Value (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I5* NIW | Thesaurierende Klasse USD I5* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD M* NIW | Thesaurierende Klasse USD M* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD Y* NIW | Thesaurierende Klasse USD Y* NIW je Anteil |
|-------------------|--------------------------------------|--|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 42.443 USD | 9,43 USD | 21.629.855 USD | 8,95 USD | 99.162.277 USD | 9,89 USD |
| 31. Dezember 2022 | 51.156 USD | 9,65 USD | 47.864.951 USD | 9,35 USD | – | – |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD Z* NIW | Thesaurierende Klasse USD Z* NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 200.943 USD | 9,90 USD |
| 31. Dezember 2022 | 13.571.781 USD | 10,10 USD |

US Long Short Equity

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR A NIW | Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I NIW | Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I3 NIW | Thesaurierende Klasse EUR I3 NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|-------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 260.420 EUR | 11,44 EUR | 32.376.271 EUR | 12,46 EUR | 35.415.422 EUR | 11,75 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 607.101 EUR | 10,40 EUR | 36.739.571 EUR | 11,22 EUR | 36.252.558 EUR | 10,54 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 1.675.441 EUR | 11,66 EUR | 60.421.071 EUR | 12,47 EUR | 130.408.305 EUR | 11,67 EUR |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Long Short Equity (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)* NIW | Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR M NIW | Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)* NIW | Thesaurierende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|------------------------------------|--|--|--|
| 31. Dezember 2023 | – | – | 2.749.134 EUR | 11,14 EUR | – | – |
| 31. Dezember 2022 | – | – | 3.231.098 EUR | 10,21 EUR | – | – |
| 31. Dezember 2021 | 31.303 EUR | 11,30 EUR | 4.350.418 EUR | 11,53 EUR | 26.260 GBP | 10,70 GBP |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse GBP I3 NIW | Ausschüttende Klasse GBP I3 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse SGD A1 NIW | Thesaurierende Klasse SGD A1 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A (PF) NIW | Thesaurierende Klasse USD A (PF) NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|-------------------------------------|---|---|---|
| 31. Dezember 2023 | 1.560.470 GBP | 11,34 GBP | 175.595 SGD | 26,86 SGD | 1.596.521 USD | 13,16 USD |
| 31. Dezember 2022 | 553.045 GBP | 10,08 GBP | 306.753 SGD | 24,13 SGD | 2.738.736 USD | 11,72 USD |
| 31. Dezember 2021 | 2.475.584 GBP | 10,98 GBP | 586.015 SGD | 26,43 SGD | 2.895.442 USD | 12,74 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD A NIW | Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A1 NIW | Thesaurierende Klasse USD A1 NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I (PF) NIW | Ausschüttende Klasse USD I (PF) NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|-------------------------------------|---|--|--|
| 31. Dezember 2023 | 15.728.474 USD | 13,33 USD | 13.821.003 USD | 14,24 USD | 35.630.199 USD | 13,83 USD |
| 31. Dezember 2022 | 15.008.727 USD | 11,86 USD | 13.820.694 USD | 12,63 USD | 32.577.472 USD | 12,33 USD |
| 31. Dezember 2021 | 19.263.231 USD | 12,97 USD | 17.243.832 USD | 13,77 USD | 37.308.429 USD | 13,31 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Long Short Equity (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I NIW | Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I3 NIW | Thesaurierende Klasse USD I3 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD M NIW | Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|--|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 31.634.246 USD | 15,29 USD | 11.481.908 USD | 12,51 USD | 951.613 USD | 12,24 USD |
| 31. Dezember 2022 | 49.565.162 USD | 13,49 USD | 13.048.932 USD | 10,99 USD | 1.229.714 USD | 10,98 USD |
| 31. Dezember 2021 | 30.548.534 USD | 14,61 USD | 123.743.798 USD | 11,85 USD | 1.323.213 USD | 12,11 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD U NIW | Thesaurierende Klasse USD U NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD Z NIW | Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 1.239.097 USD | 13,99 USD | 3.442.847 USD | 17,13 USD |
| 31. Dezember 2022 | 6.626.973 USD | 12,39 USD | 3.984.842 USD | 14,90 USD |
| 31. Dezember 2021 | 7.318.111 USD | 13,49 USD | 6.687.613 USD | 15,93 USD |

US Multi Cap Opportunities

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse AUD E NIW | Thesaurierende Klasse AUD E NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse AUD T NIW | Thesaurierende Klasse AUD T NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I3 NIW | Thesaurierende Klasse EUR I3 NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|--|--|
| 31. Dezember 2023 | 1.190.855 AUD | 18,33 AUD | 2.064.476 AUD | 17,38 AUD | 2.192.792 EUR | 26,06 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 1.517.141 AUD | 16,18 AUD | 1.676.142 AUD | 15,19 AUD | 1.895.752 EUR | 22,53 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 2.111.989 AUD | 20,43 AUD | 2.011.793 AUD | 18,99 AUD | 2.356.991 EUR | 28,01 EUR |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR M NIW | Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR1 A NIW | Thesaurierende Klasse EUR1 A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR1 I NIW | Thesaurierende Klasse EUR1 I NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|--|--|--|--|
| 31. Dezember 2023 | 485.467 EUR | 18,00 EUR | 2.025.069 EUR | 28,67 EUR | 3.590.284 EUR | 31,53 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 493.074 EUR | 15,91 EUR | 1.953.365 EUR | 25,08 EUR | 3.440.135 EUR | 27,36 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 691.776 EUR | 20,22 EUR | 2.709.496 EUR | 31,56 EUR | 5.287.010 EUR | 34,13 EUR |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert) NIW | Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse SGD A NIW | Thesaurierende Klasse SGD A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD B NIW | Thesaurierende Klasse USD B NIW je Anteil |
|-------------------|--|---|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 19.454 GBP | 18,26 GBP | 30.545.781 SGD | 48,71 SGD | 11.529.828 USD | 20,61 USD |
| 31. Dezember 2022 | 17.444 GBP | 16,38 GBP | 24.554.266 SGD | 42,26 SGD | 14.429.013 USD | 17,80 USD |
| 31. Dezember 2021 | 1.294.933 GBP | 17,50 GBP | 28.145.940 SGD | 51,87 SGD | 18.960.200 USD | 21,90 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD C1 NIW | Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD C2 NIW | Thesaurierende Klasse USD C2 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD E NIW | Thesaurierende Klasse USD E NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|--|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 1.857.404 USD | 15,79 USD | 11.020 USD | 20,62 USD | 12.497.526 USD | 19,40 USD |
| 31. Dezember 2022 | 1.855.172 USD | 13,62 USD | 775.262 USD | 17,80 USD | 12.157.572 USD | 16,75 USD |
| 31. Dezember 2021 | 2.930.473 USD | 16,74 USD | 1.349.591 USD | 21,89 USD | 14.699.492 USD | 20,60 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I2* NIW | Thesaurierende Klasse USD I2* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I3 NIW | Thesaurierende Klasse USD I3 NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I3 NIW | Ausschüttende Klasse USD I3 NIW je Anteil |
|-------------------|--------------------------------------|--|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 11.201 USD | 11,20 USD | 20.516.313 USD | 30,97 USD | 5.968.476 USD | 27,71 USD |
| 31. Dezember 2022 | – | – | 23.096.196 USD | 26,14 USD | 5.049.971 USD | 23,44 USD |
| 31. Dezember 2021 | – | – | 42.984.155 USD | 31,41 USD | 7.778.053 USD | 28,22 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD M NIW | Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD T NIW | Thesaurierende Klasse USD T NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD U NIW | Thesaurierende Klasse USD U NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 7.990.996 USD | 21,97 USD | 20.597.988 USD | 22,81 USD | 51.624.971 USD | 31,54 USD |
| 31. Dezember 2022 | 8.827.718 USD | 18,95 USD | 18.665.561 USD | 19,51 USD | 55.179.479 USD | 26,82 USD |
| 31. Dezember 2021 | 63.859.463 USD | 23,28 USD | 16.287.199 USD | 23,75 USD | 74.307.003 USD | 32,48 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD Z NIW | Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD1 A NIW | Thesaurierende Klasse USD1 A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD1 I NIW | Thesaurierende Klasse USD1 I NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 315.494 USD | 26,27 USD | 61.309.908 USD | 34,23 USD | 157.972.113 USD | 38,63 USD |
| 31. Dezember 2022 | 285.453 USD | 22,06 USD | 68.130.989 USD | 29,24 USD | 188.629.207 USD | 32,71 USD |
| 31. Dezember 2021 | 309.426 USD | 26,38 USD | 92.720.656 USD | 35,57 USD | 386.342.131 USD | 39,46 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD1 I NIW | Ausschüttende Klasse USD1 I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse ZAR B NIW | Thesaurierende Klasse ZAR B NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse ZAR C2 NIW | Thesaurierende Klasse ZAR C2 NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|-------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 6.535.567 USD | 37,27 USD | 33.968.071 ZAR | 306,92 ZAR | 52.951 ZAR | 305,28 ZAR |
| 31. Dezember 2022 | 5.497.999 USD | 31,57 USD | 44.251.345 ZAR | 258,68 ZAR | 714.961 ZAR | 257,19 ZAR |
| 31. Dezember 2021 | 9.701.682 USD | 38,08 USD | 45.494.408 ZAR | 310,31 ZAR | 2.184.221 ZAR | 308,51 ZAR |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse ZAR E NIW | Thesaurierende Klasse ZAR E NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse ZAR T NIW | Thesaurierende Klasse ZAR T NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 40.553.464 ZAR | 282,64 ZAR | 62.068.144 ZAR | 339,34 ZAR |
| 31. Dezember 2022 | 58.876.819 ZAR | 238,22 ZAR | 62.283.522 ZAR | 283,17 ZAR |
| 31. Dezember 2021 | 68.342.255 ZAR | 285,76 ZAR | 55.775.120 ZAR | 336,29 ZAR |

US Real Estate Securities

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse AUD B NIW | Thesaurierende Klasse AUD B NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|---|---|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 3.363.584 AUD | 8,36 AUD | 2.517.096 AUD | 7,64 AUD | 1.491.037 AUD | 11,86 AUD |
| 31. Dezember 2022 | 5.496.298 AUD | 8,13 AUD | 3.710.929 AUD | 7,53 AUD | 1.551.669 AUD | 11,22 AUD |
| 31. Dezember 2021 | 6.760.622 AUD | 12,16 AUD | 6.027.167 AUD | 11,41 AUD | 2.600.014 AUD | 16,33 AUD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)* | Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)* | Thesaurierende Klasse AUD C2* | Thesaurierende Klasse AUD C2* | Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) | Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) |
|-------------------|---|---|----------------------------------|----------------------------------|---|---|
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | – | – | – | – | 1.664.244 AUD | 7,63 AUD |
| 31. Dezember 2022 | 13.633 AUD | 7,54 AUD | – | – | 1.845.753 AUD | 7,52 AUD |
| 31. Dezember 2021 | 105.874 AUD | 11,42 AUD | 80.242 AUD | 17,34 AUD | 2.585.873 AUD | 11,40 AUD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse AUD E | Thesaurierende Klasse AUD E | Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) | Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) | Thesaurierende Klasse AUD T | Thesaurierende Klasse AUD T |
|-------------------|--------------------------------|--------------------------------|---|---|--------------------------------|--------------------------------|
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 684.626 AUD | 12,83 AUD | 4.085.229 AUD | 8,96 AUD | 4.675.218 AUD | 15,33 AUD |
| 31. Dezember 2022 | 1.473.276 AUD | 12,14 AUD | 4.048.009 AUD | 8,74 AUD | 5.292.429 AUD | 14,37 AUD |
| 31. Dezember 2021 | 2.325.484 AUD | 17,67 AUD | 4.853.764 AUD | 13,11 AUD | 7.209.536 AUD | 20,70 AUD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse CHF A | Thesaurierende Klasse CHF A | Thesaurierende Klasse EUR A | Thesaurierende Klasse EUR A | Thesaurierende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR I |
|-------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 1.432.392 CHF | 13,99 CHF | 942.080 EUR | 8,54 EUR | 9.589.385 EUR | 19,01 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 1.863.576 CHF | 13,32 CHF | 1.065.458 EUR | 7,98 EUR | 9.711.898 EUR | 17,63 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 2.817.702 CHF | 19,35 CHF | 2.596.896 EUR | 11,56 EUR | 55.428.758 EUR | 25,33 EUR |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR M NIW | Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse SGD A NIW | Thesaurierende Klasse SGD A NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 553.935 EUR | 11,42 EUR | 41.922.187 HKD | 9,20 HKD | 841.397 SGD | 30,21 SGD |
| 31. Dezember 2022 | 525.424 EUR | 10,78 EUR | 63.131.693 HKD | 8,82 HKD | 798.510 SGD | 27,99 SGD |
| 31. Dezember 2021 | 438.137 EUR | 15,75 EUR | 99.874.888 HKD | 12,92 HKD | 1.651.444 SGD | 39,53 SGD |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A NIW | Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD A NIW | Ausschüttende Klasse USD A NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---------------------------------|---|--------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 26.897.176 USD | 10,69 USD | 184.962.493 USD | 24,05 USD | 13.581.267 USD | 17,15 USD |
| 31. Dezember 2022 | 34.765.827 USD | 10,15 USD | 219.433.044 USD | 21,92 USD | 14.624.460 USD | 15,81 USD |
| 31. Dezember 2021 | 62.774.093 USD | 14,78 USD | 326.167.994 USD | 30,68 USD | 22.321.099 USD | 22,25 USD |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD B NIW | Thesaurierende Klasse USD B NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD C1 NIW | Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---------------------------------|---|----------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 18.281.128 USD | 8,79 USD | 10.818.583 USD | 14,60 USD | 11.437.427 USD | 12,22 USD |
| 31. Dezember 2022 | 21.360.783 USD | 8,45 USD | 17.275.041 USD | 13,48 USD | 13.832.889 USD | 11,25 USD |
| 31. Dezember 2021 | 33.168.750 USD | 12,47 USD | 29.310.925 USD | 19,11 USD | 28.282.999 USD | 15,90 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)* | Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)* | Thesaurierende Klasse USD C2* | Thesaurierende Klasse USD C2* | Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) | Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) |
|-------------------|---|---|----------------------------------|----------------------------------|---|---|
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | – | – | – | – | 7.924.348 USD | 8,79 USD |
| 31. Dezember 2022 | 285.279 USD | 8,56 USD | 345.981 USD | 13,47 USD | 9.804.365 USD | 8,45 USD |
| 31. Dezember 2021 | 749.291 USD | 12,63 USD | 688.744 USD | 19,10 USD | 15.300.421 USD | 12,47 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD E | Thesaurierende Klasse USD E | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) | Thesaurierende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD I |
|-------------------|--------------------------------|--------------------------------|---|---|--------------------------------|--------------------------------|
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 7.630.425 USD | 13,85 USD | 214.529 USD | 9,22 USD | 109.751.203 USD | 27,36 USD |
| 31. Dezember 2022 | 11.862.421 USD | 12,79 USD | 202.117 USD | 8,69 USD | 136.972.776 USD | 24,75 USD |
| 31. Dezember 2021 | 24.475.060 USD | 18,13 USD | 344.192 USD | 12,56 USD | 195.054.656 USD | 34,38 USD |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD I | Ausschüttende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD I2 | Thesaurierende Klasse USD I2 | Thesaurierende Klasse USD M | Thesaurierende Klasse USD M |
|-------------------|-------------------------------|-------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil | NIW | NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2023 | 8.362.345 USD | 15,75 USD | 17.723.091 USD | 20,15 USD | 35.815.499 USD | 14,25 USD |
| 31. Dezember 2022 | 8.086.151 USD | 14,51 USD | 16.291.811 USD | 18,19 USD | 47.619.174 USD | 13,12 USD |
| 31. Dezember 2021 | 10.560.006 USD | 20,43 USD | 2.122.857 USD | 25,22 USD | 77.016.676 USD | 18,55 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD T NIW | Thesaurierende Klasse USD T NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD Z NIW | Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 11.734.470 USD | 10,21 USD | 17.063.493 USD | 16,18 USD | 1.163.860 USD | 16,00 USD |
| 31. Dezember 2022 | 12.964.064 USD | 9,72 USD | 17.827.622 USD | 14,79 USD | 2.792.788 USD | 14,36 USD |
| 31. Dezember 2021 | 19.323.514 USD | 14,20 USD | 27.328.508 USD | 20,76 USD | 8.756.783 USD | 19,79 USD |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse ZAR B NIW | Thesaurierende Klasse ZAR B NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)* NIW | Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)* NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---------------------------------------|---|--|--|
| 31. Dezember 2023 | 80.144.798 ZAR | 80,01 ZAR | 22.512.585 ZAR | 179,65 ZAR | – | – |
| 31. Dezember 2022 | 95.145.043 ZAR | 78,11 ZAR | 32.016.598 ZAR | 162,51 ZAR | 2.020.359 ZAR | 77,23 ZAR |
| 31. Dezember 2021 | 138.032.992 ZAR | 117,12 ZAR | 47.169.493 ZAR | 224,68 ZAR | 6.006.511 ZAR | 115,79 ZAR |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse ZAR C2 NIW | Thesaurierende Klasse ZAR C2 NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse ZAR E NIW | Thesaurierende Klasse ZAR E NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|--|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 315.043 ZAR | 177,41 ZAR | 41.472.352 ZAR | 80,02 ZAR | 27.239.513 ZAR | 200,99 ZAR |
| 31. Dezember 2022 | 955.698 ZAR | 160,47 ZAR | 50.137.837 ZAR | 78,12 ZAR | 28.025.473 ZAR | 181,81 ZAR |
| 31. Dezember 2021 | 1.359.201 ZAR | 221,86 ZAR | 84.148.761 ZAR | 117,13 ZAR | 31.306.257 ZAR | 251,37 ZAR |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) NIW | Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse ZAR T NIW | Thesaurierende Klasse ZAR T NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 97.954.018 ZAR | 124,36 ZAR | 40.917.501 ZAR | 249,46 ZAR |
| 31. Dezember 2022 | 103.488.803 ZAR | 120,20 ZAR | 47.847.359 ZAR | 223,40 ZAR |
| 31. Dezember 2021 | 142.721.631 ZAR | 178,43 ZAR | 48.481.475 ZAR | 305,79 ZAR |

US Small Cap

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse AUD B NIW | Thesaurierende Klasse AUD B NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse AUD C2 NIW | Thesaurierende Klasse AUD C2 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse AUD E NIW | Thesaurierende Klasse AUD E NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|--|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 1.742.449 AUD | 11,99 AUD | 11.823 AUD | 11,70 AUD | 2.052.624 AUD | 16,78 AUD |
| 31. Dezember 2022 | 1.174.595 AUD | 10,86 AUD | 17.906 AUD | 10,59 AUD | 1.486.516 AUD | 15,20 AUD |
| 31. Dezember 2021 | 1.981.465 AUD | 14,09 AUD | 16.019 AUD | 13,74 AUD | 2.328.434 AUD | 19,71 AUD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse AUD T NIW | Thesaurierende Klasse AUD T NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR A NIW | Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|--|--|
| 31. Dezember 2023 | 1.621.168 AUD | 15,66 AUD | 1.411.931 EUR | 17,04 EUR | 368.951 EUR | 13,95 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 1.570.235 AUD | 14,04 AUD | 2.265.778 EUR | 15,29 EUR | 368.888 EUR | 12,63 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 1.820.027 AUD | 18,03 AUD | 3.484.945 EUR | 19,76 EUR | 258.498 EUR | 14,80 EUR |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Small Cap (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I NIW | Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------|---|---|---|--|--|
| 31. Dezember 2023 | 7.003.214 EUR | 20,33 EUR | 4.743.299 EUR | 18,23 EUR | 8.827.680 EUR | 17,02 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 3.429.996 EUR | 18,08 EUR | 3.457.660 EUR | 16,36 EUR | 22.369.014 EUR | 15,26 EUR |
| 31. Dezember 2021 | 15.210.300 EUR | 23,17 EUR | 5.166.629 EUR | 19,01 EUR | 22.971.126 EUR | 17,70 EUR |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)* NIW | Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR M NIW | Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR Z NIW | Thesaurierende Klasse EUR Z NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|---------------------------------|---|---------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 49.451.043 EUR | 11,02 EUR | 359.461 EUR | 17,10 EUR | 373.669 EUR | 19,39 EUR |
| 31. Dezember 2022 | 38.159.092 EUR | 9,86 EUR | 213.152 EUR | 15,49 EUR | 323.177 EUR | 17,10 EUR |
| 31. Dezember 2021 | – | – | 196.729 EUR | 20,22 EUR | 405.073 EUR | 21,73 EUR |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert) NIW | Ausschüttende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A NIW | Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD A NIW | Ausschüttende Klasse USD A NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---------------------------------|---|--------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 4.420.253.539 JPY | 5,94 JPY | 102.356.393 USD | 27,90 USD | 11.394.615 USD | 18,01 USD |
| 31. Dezember 2022 | 4.342.939.609 JPY | 4,82 JPY | 96.318.017 USD | 24,40 USD | 10.366.064 USD | 15,75 USD |
| 31. Dezember 2021 | 5.847.817.173 JPY | 5,21 JPY | 190.419.002 USD | 30,47 USD | 14.304.320 USD | 19,67 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Small Cap (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD B NIW | Thesaurierende Klasse USD B NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD C2 NIW | Thesaurierende Klasse USD C2 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD E NIW | Thesaurierende Klasse USD E NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 9.816.052 USD | 20,47 USD | 3.134 USD | 20,50 USD | 4.842.626 USD | 18,05 USD |
| 31. Dezember 2022 | 7.251.318 USD | 18,10 USD | 61.322 USD | 18,12 USD | 2.587.858 USD | 15,96 USD |
| 31. Dezember 2021 | 10.526.062 USD | 22,86 USD | 181.210 USD | 22,89 USD | 7.216.838 USD | 20,15 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I NIW | Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I NIW | Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I3 NIW | Thesaurierende Klasse USD I3 NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|-----------------------------------|---|-------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 235.603.429 USD | 31,17 USD | 23.788.319 USD | 22,68 USD | 116.444.993 USD | 15.647,89 USD |
| 31. Dezember 2022 | 225.900.152 USD | 27,02 USD | 21.992.051 USD | 19,66 USD | 101.463.016 USD | 13.534,58 USD |
| 31. Dezember 2021 | 263.869.062 USD | 33,46 USD | 36.174.960 USD | 24,35 USD | 84.251.233 USD | 16.717,30 USD |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD M NIW | Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD T NIW | Thesaurierende Klasse USD T NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD Z NIW | Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 4.726.621 USD | 20,63 USD | 7.744.749 USD | 22,73 USD | 1.801.567 USD | 21,30 USD |
| 31. Dezember 2022 | 3.240.409 USD | 18,23 USD | 7.242.861 USD | 19,89 USD | 2.213.208 USD | 18,32 USD |
| 31. Dezember 2021 | 90.250.100 USD | 22,98 USD | 8.388.800 USD | 24,87 USD | 3.275.208 USD | 22,49 USD |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Small Cap (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse ZAR E NIW | Thesaurierende Klasse ZAR E NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse ZAR T NIW | Thesaurierende Klasse ZAR T NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 8.580.171 ZAR | 261,62 ZAR | 16.439.253 ZAR | 220,56 ZAR |
| 31. Dezember 2022 | 18.435.416 ZAR | 226,59 ZAR | 18.202.064 ZAR | 189,12 ZAR |
| 31. Dezember 2021 | 21.140.644 ZAR | 279,01 ZAR | 30.686.645 ZAR | 230,55 ZAR |

US Small Cap Intrinsic Value

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I2 (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse GBP I2 (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse JPY I3 (nicht währungsgesichert)* NIW | Thesaurierende Klasse JPY I3 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|--|--|---|---|
| 31. Dezember 2023 | 76.995.502 GBP | 10,82 GBP | 18.429.244 GBP | 10,05 GBP | 641.072.643 JPY | 1.012,53 JPY |
| 31. Dezember 2022 | 42.248.255 GBP | 10,04 GBP | 13.137.811 GBP | 9,31 GBP | – | – |
| 31. Dezember 2021 | 22.099.755 GBP | 11,24 GBP | 9.171.753 GBP | 10,40 GBP | – | – |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD A NIW | Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I NIW | Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I2* NIW | Thesaurierende Klasse USD I2* NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|--------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | 9.039.299 USD | 21,63 USD | 116.918.013 USD | 19,18 USD | 68.837.919 USD | 9,66 USD |
| 31. Dezember 2022 | 8.698.122 USD | 19,11 USD | 85.094.541 USD | 16,80 USD | 32.935.389 USD | 8,44 USD |
| 31. Dezember 2021 | 9.101.564 USD | 24,28 USD | 101.565.129 USD | 21,17 USD | – | – |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Small Cap Intrinsic Value (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD M NIW | Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | 415.451 USD | 17,79 USD |
| 31. Dezember 2022 | 500.654 USD | 15,88 USD |
| 31. Dezember 2021 | 579.481 USD | 20,38 USD |

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

¹ Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

² Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

Bei den angegebenen Beträgen zum Nettoinventarwert und Nettoinventarwert je Anteil handelt es sich um Werte für den Handel mit Anteilhabern.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

14. WECHSELKURSE

Zur Umrechnung der auf Fremdwährungen lautenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten am Ende des Geschäftsjahres (31. Dezember 2023) wurden die folgenden Wechselkurse verwendet

| | | | | |
|-------------------------|--------------------------|-------------------------|-----------------------|--------------------------|
| 1 USD = 3,67275 AED | 1 USD = 22,34960 CZK | 1 USD = 3,60090 ILS | 1 USD = 1,57940 NZD | 1 USD = 1,31910 SGD |
| 1 USD = 975,38000 ARS | 1 USD = 6,74835 DKK | 1 USD = 83,21375 INR | 1 USD = 3,70260 PEN | 1 USD = 34,13250 THB |
| 1 USD = 1,46552 AUD | 1 USD = 58,06000 DOP | 1 USD = 140,98000 JPY | 1 USD = 55,37500 PHP | 1 USD = 29,53400 TRY |
| 1 USD = 4,85760 BRL | 1 USD = 30,92500 EGP | 1 USD = 157,00000 KES | 1 USD = 3,93225 PLN | 1 USD = 30,69050 TWD |
| 1 USD = 1,31860 CAD | 1 USD = 0,90526 EUR | 1 USD = 1.287,90000 KRW | 1 USD = 3,64100 QAR | 1 USD = 3.780,00000 UGX |
| 1 USD = 0,84165 CHF | 1 USD = 0,78444 GBP | 1 USD = 455,89000 KZT | 1 USD = 4,50360 RON | 1 USD = 39,04000 UYU |
| 1 USD = 873,28500 CLP | 1 USD = 11,91500 GHS | 1 USD = 16,93450 MXN | 1 USD = 106,13000 RSD | 1 USD = 24.262,00000 VND |
| 1 USD = 7,12060 CNH | 1 USD = 7,80855 HKD | 1 USD = 4,59500 MYR | 1 USD = 89,40000 RUB | 1 USD = 18,28750 ZAR |
| 1 USD = 7,09220 CNY | 1 USD = 346,00555 HUF | 1 USD = 897,50000 NGN | 1 USD = 3,75000 SAR | 1 USD = 25,71030 ZMW |
| 1 USD = 3.874,00000 COP | 1 USD = 15.397,00000 IDR | 1 USD = 10,15570 NOK | 1 USD = 10,07785 SEK | |
| 1 EUR = 1,61889 AUD | 1 EUR = 24,68849 CZK | 1 EUR = 8,62571 HKD | 1 EUR = 4,34376 PLN | 1 EUR = 1,45714 SGD |
| 1 EUR = 1,45659 CAD | 1 EUR = 7,45456 DKK | 1 EUR = 155,73356 JPY | 1 EUR = 11,13250 SEK | 1 EUR = 1,10465 USD |
| 1 EUR = 0,92973 CHF | 1 EUR = 0,86653 GBP | 1 EUR = 11,21849 NOK | | |
| 1 CNH = 1,00000 CNY | 1 CNH = 0,11016 GBP | 1 CNH = 0,18525 SGD | | |
| 1 CNH = 0,12713 EUR | 1 CNH = 1,09661 HKD | 1 CNH = 0,14044 USD | | |
| 1 ¥ = 0,00642 EUR | 1 ¥ = 0,00556 GBP | 1 ¥ = 0,00709 USD | | |

Zur Umrechnung der auf Fremdwährungen lautenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten am Ende des Geschäftsjahres (31. Dezember 2022) wurden die folgenden Wechselkurse verwendet

| | | | | |
|-------------------------|--------------------------|-------------------------|-----------------------|--------------------------|
| 1 USD = 3,67265 AED | 1 USD = 22,63200 CZK | 1 USD = 3,52850 ILS | 1 USD = 3,81350 PEN | 1 USD = 34,63500 THB |
| 1 USD = 324,90000 ARS | 1 USD = 6,96785 DKK | 1 USD = 82,73000 INR | 1 USD = 55,72750 PHP | 1 USD = 18,71950 TRY |
| 1 USD = 1,47460 AUD | 1 USD = 56,22000 DOP | 1 USD = 131,94500 JPY | 1 USD = 4,38625 PLN | 1 USD = 30,73550 TWD |
| 1 USD = 5,27975 BRL | 1 USD = 24,75500 EGP | 1 USD = 123,40000 KES | 1 USD = 3,64175 QAR | 1 USD = 3.720,00000 UGX |
| 1 USD = 1,35495 CAD | 1 USD = 0,93699 EUR | 1 USD = 1.264,50000 KRW | 1 USD = 4,63605 RON | 1 USD = 39,76500 UYU |
| 1 USD = 0,92520 CHF | 1 USD = 0,83132 GBP | 1 USD = 19,48725 MXN | 1 USD = 109,92500 RSD | 1 USD = 23.575,00000 VND |
| 1 USD = 851,95000 CLP | 1 USD = 10,20000 GHS | 1 USD = 4,40500 MYR | 1 USD = 73,00000 RUB | 1 USD = 17,01500 ZAR |
| 1 USD = 6,91885 CNH | 1 USD = 7,80495 HKD | 1 USD = 460,75000 NGN | 1 USD = 3,75800 SAR | 1 USD = 18,07500 ZMW |
| 1 USD = 6,95170 CNY | 1 USD = 375,21670 HUF | 1 USD = 9,85100 NOK | 1 USD = 10,41950 SEK | |
| 1 USD = 4.848,88500 COP | 1 USD = 15.567,50000 IDR | 1 USD = 1,58115 NZD | 1 USD = 1,34120 SGD | |
| 1 EUR = 1,57377 AUD | 1 EUR = 7,43644 DKK | 1 EUR = 140,81830 JPY | 1 EUR = 4,68123 PLN | 1 EUR = 1,43140 SGD |
| 1 EUR = 1,44607 CAD | 1 EUR = 0,88723 GBP | 1 EUR = 10,51348 NOK | 1 EUR = 11,12021 SEK | 1 EUR = 1,06725 USD |
| 1 EUR = 0,98742 CHF | 1 EUR = 8,32983 HKD | | | |
| 1 CNH = 1,00000 CNY | 1 CNH = 0,12015 GBP | 1 CNH = 0,19385 SGD | | |
| 1 CNH = 0,13543 EUR | 1 CNH = 1,12807 HKD | 1 CNH = 0,14453 USD | | |
| 1 ¥ = 0,00758 USD | | | | |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

14. WECHSELKURSE (FORTSETZUNG)

| | | | | | |
|------|----------------------------|-----|-------------------------|-----|-----------------------------|
| AED | VAE-Dirham | HKD | Hongkong-Dollar | QAR | Katar-Rial |
| ARS | Argentinischer Peso | HUF | Ungarischer Forint | RON | Rumänischer neuer Leu |
| AUD | Australischer Dollar | IDR | Indonesische Rupiah | RSD | Serbischer Dinar |
| BRL | Brasilianischer Real | ILS | Israelischer Schekel | RUB | Russischer Rubel |
| CAD | Kanadischer Dollar | INR | Indische Rupie | SAR | Saudi-Riyal |
| CHF | Schweizer Franken | JPY | Japanischer Yen (¥) | SEK | Schwedische Krone |
| CLP | Chilenischer Peso | KES | Kenianischer Schilling | SGD | Singapur-Dollar |
| *CNH | Chinesischer Yuan Renminbi | KRW | Südkoreanischer Won | THB | Thailändischer Baht |
| *CNY | Chinesischer Yuan Renminbi | KZT | Kasachischer Tenge | TRY | Türkische Lira |
| COP | Kolumbianischer Peso | MXN | Mexikanischer Peso | TWD | Neuer taiwanesischer Dollar |
| CZK | Tschechische Krone | MYR | Malaysischer Ringgit | UGX | Uganda-Schilling |
| DKK | Dänische Krone | NGN | Nigerianischer Naira | USD | US-Dollar (\$) |
| DOP | Dominikanischer Peso | NOK | Norwegische Krone | UYU | Uruguayischer Peso |
| EGP | Ägyptisches Pfund | NZD | Neuseeländischer Dollar | VND | Vietnamesischer Dong |
| EUR | Euro (€) | PEN | Peruanischer Sol | ZAR | Südafrikanischer Rand |
| GBP | Britisches Pfund (£) | PHP | Philippinischer Peso | ZMW | Sambischer Kwacha |
| GHS | Ghanaischer Cedi | PLN | Polnischer Zloty | | |

*Es gibt in China eine offizielle Währung, den chinesischen Yuan Renminbi. Der CNY wird „onshore“, auf dem chinesischen Festland, gehandelt, der CNH „offshore“, in erster Linie in Hongkong, zu jeweils unterschiedlichen Wechselkursen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR**15. BERICHTIGUNG DER WÄHRUNGSUMRECHNUNG**

Der Konzernabschluss für den Fonds ist auf US-Dollar denominated. Zum Zwecke der Berichterstattung der Gesamtergebnisse des Fonds wurden die Ergebnisse einiger Portfolios zu den nachstehend angegebenen Kursen in US-Dollar umgerechnet.

| Portfolio | Bilanz | | Gewinn- und Verlustrechnung und die Aufstellung über die Entwicklung der auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens | |
|-----------------------------|-----------------------|-----------------------|--|-----------------------|
| | Schlusskurs | | Durchschnittskurs | |
| | 31.Dezember 2023 | 31.Dezember 2022 | 31.Dezember 2023 | 31.Dezember 2022 |
| China A-Share Equity | US\$ 1 = CNY 7,09220 | US\$ 1 = CNY 6,95170 | US\$ 1 = CNY 7,08452 | US\$ 1 = CNY 6,72665 |
| China Bond | US\$ 1 = CNY 7,09220 | US\$ 1 = CNY 6,95170 | US\$ 1 = CNY 7,08452 | US\$ 1 = CNY 6,72665 |
| Corporate Hybrid Bond | US\$ 1 = EUR 0,90526 | US\$ 1 = EUR 0,93699 | US\$ 1 = EUR 0,92479 | US\$ 1 = EUR 0,94726 |
| Euro Bond | US\$ 1 = EUR 0,90526 | US\$ 1 = EUR 0,93699 | US\$ 1 = EUR 0,92479 | US\$ 1 = EUR 0,94726 |
| Euro Bond Absolute Return | US\$ 1 = EUR 0,90526 | US\$ 1 = EUR 0,93699 | US\$ 1 = EUR 0,92479 | US\$ 1 = EUR 0,94726 |
| European High Yield Bond | US\$ 1 = EUR 0,90526 | US\$ 1 = EUR 0,93699 | US\$ 1 = EUR 0,92479 | US\$ 1 = EUR 0,94726 |
| European Sustainable Equity | US\$ 1 = EUR 0,90526 | US\$ 1 = EUR 0,93699 | US\$ 1 = EUR 0,92479 | US\$ 1 = EUR 0,94726 |
| Japan Equity Engagement | US\$ 1 = JPY 140,9800 | US\$ 1 = JPY 131,9450 | US\$ 1 = JPY 140,6815 | US\$ 1 = JPY 130,6254 |
| Macro Opportunities FX | US\$ 1 = EUR 0,90526 | US\$ 1 = EUR 0,93699 | US\$ 1 = EUR 0,92479 | US\$ 1 = EUR 0,94726 |
| Ultra Short Term Euro Bond | US\$ 1 = EUR 0,90526 | US\$ 1 = EUR 0,93699 | US\$ 1 = EUR 0,92479 | US\$ 1 = EUR 0,94726 |

Aus der Umrechnung des Eröffnungsnettovermögens, der Gewinn- und Verlustrechnung und der Aufstellung über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens ergab sich eine nominale Währungsanpassung von USD (111.001.114) (31. Dezember 2022: (304.151.197) US\$). Die Umrechnungsmethode hat keinen Einfluss auf den Wert des Nettovermögens, der den einzelnen Portfolios zuzuschreiben ist.

16. VEREINBARUNGEN ÜBER PROVISIONSNACHLÄSSE (SOFT COMMISSIONS)

Der Manager und verbundene Personen haben in begrenzten Fällen Vereinbarungen über Provisionsnachlässe mit Brokern in Bezug auf Research-Produkte abgeschlossen unter der Voraussetzung, dass sie die beste Ausführung (Best Execution) zur Unterstützung von Anlagenentscheidungen erhalten.

Zu den erhaltenen Research-Leistungen gehören alle standardmäßigen Research-Produkte, insbesondere aktuelle und historische Daten in Bezug auf bestimmte Unternehmen, Branchen und die Finanzwirtschaft insgesamt sowie Informationen über Chancen, Risiken und Trends sowie Analysen in Bezug auf spezielle Situationen. Der Manager ist der Auffassung, dass diese Vereinbarungen den Portfolios zugute kommen, und hat sich davon überzeugt, dass er für die Portfolios die beste Ausführung erhält.

17. GETRENNTE HAFTUNG

Der Fonds hat mehrere Portfolios und weitere Portfolios können künftig aufgelegt werden. Mit der Zustimmung der Anteilhaber des Fonds, die am 3. November 2006 durch einen Sonderbeschluss erteilt wurde, hat der Fonds die getrennte Haftung zwischen seinen Portfolios eingeführt. Ab diesem Datum trägt jedes Portfolio seine eigenen Verbindlichkeiten, und weder der Fonds noch die vom Fonds ernannten Dienstleistungsanbieter noch die Direktoren, Konkursverwalter, Prüfer oder Liquidatoren noch eine sonstige Person erhalten Zugriff auf die Vermögenswerte eines Portfolios zur Begleichung von Verbindlichkeiten eines anderen Portfolios.

18. EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT

Der Fonds kann zu den Bedingungen und innerhalb der Grenzen, die von der Zentralbank vorgegeben werden, in Bezug auf Wertpapiere und/oder Finanzinstrumente, einschließlich derivative Instrumente, Anlagetechniken und Instrumente anwenden, vorausgesetzt, dass diese für Zwecke des effizienten Portfoliomanagements (d. h. zur Absicherung, zur Reduzierung von Risiken oder Kosten oder zur Steigerung der Kapital- oder Ertragsrendite) oder für Anlagezwecke angewandt werden. Die angewandten Techniken und Instrumente dürfen nur in Einklang mit den Anlagezielen des jeweiligen Portfolios eingesetzt werden.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

18. EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT (Fortsetzung)

Nach Ermessen des Managers und des Sub-Investment-Managers kann jedes Portfolio zu den von den OGAW-Vorschriften der Zentralbank festgelegten Bedingungen und Grenzen für alle Arten von Vermögenswerten, in die das Portfolio anlegen kann, Wertpapierleihgeschäfte („Wertpapierleihverträge“) abschließen, so wie im Abschnitt „Instrumente/Anlageklassen“ im jeweiligen Zusatz für das Portfolio beschrieben. Solche Wertpapierleihgeschäfte können zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements eingesetzt werden.

Wertpapierleihverträge sind Transaktionen, über die ein Portfolio seine Wertpapiere an eine andere Partei, den Kreditnehmer, ausleiht, der vertraglich verpflichtet ist, zum Ende eines vereinbarten Zeitraums äquivalente Wertpapiere zurückzugeben. Solange die Wertpapiere ausgeliehen sind, zahlt der Kreditnehmer dem Portfolio (i) eine Kreditgebühr und (ii) Erträge aus den Wertpapieren.

Der Fonds erhielt für jedes Portfolio, das Wertpapierleihverträge abschloss, Sicherheiten in Höhe von mindestens 102 % des Werts der ausgeliehenen Wertpapiere. Portfolios können nur Wertpapierleihgeschäfte abschließen, im Rahmen derer (i) sie berechtigt sind, zu jeder Zeit die Rückgabe der verliehenen Wertpapiere zu beantragen oder die Wertpapierleihgeschäfte zu kündigen und (ii) die Transaktionen die Verwaltung der Vermögenswerte des Portfolios im Einklang mit seiner Anlagepolitik nicht gefährden. Sofern nicht anderweitig in dem entsprechenden Zusatz festgelegt, beträgt der maximale Anteil eines Nettoinventarwerts eines Portfolios, für den Wertpapierleihgeschäfte abgeschlossen werden können, 50 % und der erwartete Anteil eines Nettoinventarwerts, für den Wertpapierleihgeschäfte abgeschlossen werden, beträgt 0-10 %.

Der Fonds hat Brown Brothers Harriman & Co. (der „Lending Agent“) damit beauftragt, die Wertpapierleihverträge auszuführen, darunter, vorbehaltlich der vorherigen Zustimmung durch den Fonds, die Auswahl der Gegenparteien und die Verwaltung der Sicherheit. Portfolios, die Wertpapierleihverträge eingingen, erhielten das gesamte Einkommen aus diesen Wertpapierleihverträgen, abzüglich direkter und indirekter Betriebskosten, das 90 % des insgesamt generierten Einkommens ausmachte. Die übrigen 10 % wurden an den Lending Agent als Gegenleistung für die direkten und indirekten Betriebskosten für die Erbringung seiner Dienstleistungen und die Bereitstellung seiner Garantie gezahlt. Die Gesellschaft stieg im Juli 2022 aus dem Wertpapierleihprogramm aus, die von den Portfolios in den entsprechenden Zeitraum aus der Wertpapierleihe verdienten Erträge werden separat in der Gewinn- und Verlustrechnung aufgeführt.

Zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 hatte der Fonds keine Wertpapierleihgeschäfte abgeschlossen.

Im zum 31. Dezember 2023 endenden Geschäftsjahr haben der Corporate Hybrid Bond, der Emerging Market Debt Blend und der Short Duration Emerging Market Debt Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte abgeschlossen. Die gesamten Zinserträge aus Pensionsgeschäften und umgekehrten Pensionsgeschäften lagen für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 bei 1.613 US\$ bzw. 38.355 US\$. Die gesamten Zinsaufwendungen aus Pensionsgeschäften und umgekehrten Pensionsgeschäften lagen für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 bei 2.677 US\$ bzw. 175.821 US\$. Direkte und indirekte Kosten im Zusammenhang mit effizienten Portfoliomanagementtechniken können nicht ohne Weiteres bestimmt werden.

Im zum 31. Dezember 2022 endenden Geschäftsjahr haben der Corporate Hybrid Bond, der Emerging Market Debt - Hard Currency, der Emerging Market Debt Blend, der High Yield Bond und der Short Duration Emerging Market Debt Pensionsgeschäfte abgeschlossen. Die gesamten Zinserträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften lagen für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 bei 140.059 US\$. Die gesamten Zinsaufwendungen aus umgekehrten Pensionsgeschäften lagen für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 bei 6.300 US\$. Direkte und indirekte Kosten im Zusammenhang mit effizienten Portfoliomanagementtechniken können nicht ohne Weiteres bestimmt werden.

19. KREDITFAZILITÄT

Bei der Sitzung der Direktoren vom 20. Juni 2016 wurde mit The Bank of Tokyo Mitsubishi UFJ Ltd. vereinbart, dass sie zusammen mit einem Syndikat von anderen Banken (zusammen die „Kreditgeber“) dem Fonds in Bezug auf die Portfolios ab dem Datum der Ausfertigung eines Kreditvertrags mit der Bank eine zugesagte Liquiditätsfazilität bis zu einem Höchstbetrag von 500.000.000 US\$ (die „Fazilität“) zur Verfügung stellt, und dass der Gegenwert der Fazilität nur für den vorübergehenden Liquiditätsbedarf oder in Notlagen in Anspruch genommen werden darf. Die Fazilität in Höhe von 850.000.000 US\$ wurde am 28. September 2023 für den Zeitraum von 364 Tagen für sämtliche Portfolios verlängert. Die Kosten für die Bereitstellungsprovision wurden dementsprechend geändert.

Zum 31. Dezember 2023 gab es keine im Rahmen der Fazilität ausstehenden Kredite (31. Dezember 2022: ebenso). In den Geschäftsjahren zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 wurde die Kreditfazilität von keinem der Portfolios in Anspruch genommen.

20. UNGEDECKTE KREDITZUSAGEN

Zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 hatte der Fonds keine ungedeckten Kreditverbindlichkeiten.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR**21. WICHTIGE EREIGNISSE WÄHREND DES GESCHÄFTSJAHR**

Die wirtschaftlichen Unsicherheiten und Unsicherheiten am Finanzmarkt blieben angetrieben durch die anhaltend höhere Inflation und die Straffung der Geldpolitik weiter erhöht, da die Zentralbanken die Basiszinssätze erhöht und die Kreditbedingungen verschärft haben, was jüngste Ereignisse im Bankensektor zeigen. Diese Marktbedingungen tragen zu einer zusätzlichen Volatilität und Fluktuation bei den Marktvariablen bei, einschließlich unter anderem den Zinsen, Wechselkursen, Aktienkursen, Rohstoffpreisen, einer Erhöhung der Kreditspreads, implizierter Volatilitäten und Asset-Korrelationen. Das Management überwacht die Ereignisse und jegliche Engagements in Sektoren mit erhöhtem Risiko aktiv.

Ein neuer Multi-Strategy-Nachtrag zum Prospekt, der die Änderung der Berechnungsmethode der erfolgsabhängigen Gebühr für den Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund abdeckt, wurde von der Zentralbank am 3. Januar 2023 vermerkt.

Am 3. Januar 2023 wurden von der Zentralbank ein neuer Sustainable Asia High Yield-Nachtrag zum Prospekt vermerkt.

Am 7. Februar 2023 wurden von der Zentralbank ein neuer Fixed Income-Nachtrag zum Prospekt vermerkt.

Der Neuberger Berman Uncorrelated Trading Fund wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

Der Neuberger Berman Global High Yield Sustainable Action Fund wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

Der Neuberger Berman Tactical Macro Fund wurde am 30. Juni 2023 aufgelegt.

Tom Finlay trat am 30. Juni 2023 als Direktor des Fonds in den Ruhestand.

Mit Wirkung vom 1. Juli 2023 löste Naomi Daly Tom Finlay als Vorsitzenden ab.

Der Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

Der Neuberger Berman Developed Market FMP – 2027 wurde am 31. Juli 2023 aufgelegt.

Der Neuberger Berman Climate Innovation Fund wurde am 1. August 2023 aufgelegt.

Eine neue Version des Prospekts des Fonds und neue Zusätze zum Verkaufsprospekt, die sich auf Veränderungen aller Portfolios beziehen, wurden am 2. August 2023 von der Zentralbank entgegengenommen. Die Nachträge zum Verkaufsprospekt umfassen Änderungen an folgenden Fonds: Neuberger Berman China Equity Fund, Neuberger Berman Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency Fund, Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund, Neuberger Berman Global Flexible Credit Income Fund, Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund, Neuberger Berman European High Yield Bond Fund, Neuberger Berman Global High Yield SDG Engagement Fund, Neuberger Berman Next Generation Space Economy Fund, Neuberger Berman InnovAsia 5G Fund, Neuberger Berman Global Equity Megatrends Fund, Neuberger Berman Systematic Global Sustainable Value Fund, Neuberger Berman Global Real Estate Securities Fund, Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund, Neuberger Berman Sustainable Asia High Yield Fund und Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund.

Mit Wirkung zum 2. August 2023 wurde der Neuberger Berman Systematic Global Sustainable Value Fund in Neuberger Berman Global Sustainable Value Fund umbenannt.

Auf Empfehlung des Managers und in Übereinstimmung mit den Bedingungen des Prospekts und den Bestimmungen der Satzung hat der Verwaltungsrat als Schließungsdatum für den Neuberger Berman Emerging Markets Select Equity Fund den 7. September 2023 genehmigt.

Mit Wirkung zum 2. Oktober 2023 wurde der Neuberger Berman Asian Debt - Hard Currency Fund in Neuberger Berman Responsible Asian Debt – Hard Currency Fund umbenannt.

Mit Wirkung zum 5. Oktober 2023 stellte die Alcova Asset Management LLP ihre Tätigkeit als nicht verbundener Unterberater des Fonds ein.

Mit Wirkung zum 22. November 2023 wurde die G10 Capital Limited zum nicht verbundenen Unterberater des Fonds bestellt.

Mit Wirkung zum 23. November 2023 wurde die Cipher Capital LP zum nicht verbundenen Unterberater des Fonds bestellt.

Eine neue Version des Prospekts des Fonds und neue Zusätze zum Verkaufsprospekt, die sich auf Veränderungen aller Portfolios beziehen, wurden am 6. Dezember 2023 von der Zentralbank entgegengenommen. Die Nachträge zum aktualisierten Verkaufsprospekt umfassen die automatische Umwandlung von Anteilen der Klassen der Kategorien B, C2 und E in Anteile der entsprechenden Klasse A ohne zusätzliche Kosten für die Inhaber solcher Anteile nach Ablauf von vier Jahren (Klassen der Kategorie B), zwei Jahren (Klassen der Kategorie C2) und drei Jahren (Klassen der Kategorie E) ab dem Datum der Erstzeichnung der betreffenden Klasse B, C2 oder E.

Mit Wirkung zum 6. Dezember 2023 wurde der Neuberger Berman Euro Opportunistic Bond Fund in Neuberger Berman Euro Bond Fund umbenannt.

Mit Wirkung zum 15. Dezember 2023 stellte die Sandbar Asset Management LLP ihre Tätigkeit als nicht verbundener Unterberater des Fonds ein.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

21. WICHTIGE EREIGNISSE WÄHREND DES GESCHÄFTSJAHRES (FORTSETZUNG)

Die Neuberger Berman Fund Management (China) Limited ersetzte die Neuberger Berman Investment Management (Shanghai) Limited als Anlageberater für den Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund, den Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund und den Neuberger Berman China Bond Fund.

Außer den oben erwähnten sind während des Geschäftsjahres keine wesentlichen, den Fonds betreffenden Ereignisse eingetreten.

22. WESENTLICHE EREIGNISSE SEIT DEM ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES

Mit Wirkung zum 1. Februar 2024 wurde die Managementgebühr für den Neuberger Berman Global Equity Megatrends Fund für die Thesaurierende Klasse EUR I und die Thesaurierende Klasse USD I von 0,85 % auf 0,80 %, für die Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert), die Thesaurierende Klasse SGD A, die Thesaurierende Klasse USD A, die Thesaurierende Klasse USD C1, die Thesaurierende Klasse USD M von 1,70 % auf 1,60 % und für die Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) von 0,81 % auf 0,76 % gesenkt.

Der Neuberger Berman Macro Opportunities FX Fund wurde am 8. Februar 2024 aufgelöst.

Im Zeitraum vom 1. Januar 2024 bis einschließlich 17. April 2024 gab es Zeichnungen und Rücknahmen in erheblichem Umfang, die in nachstehender Tabelle aufgeführt sind:

| Portfolio | Währung | Zeichnungen | Rücknahmen |
|--|---------|---------------|-------------|
| 5G Connectivity | USD | 80.992.584 | 170.735.714 |
| China Bond | CNY | - | 283.356.927 |
| China Equity | USD | - | 33.679.932 |
| CLO Income | USD | 62.938.053 | - |
| Commodities | USD | 14.552.424 | 19.998.728 |
| Corporate Hybrid Bond | EUR | 271.439.909 | 196.768.715 |
| Emerging Market Debt - Hard Currency | USD | 312.608.075 | 390.360.813 |
| Emerging Market Debt - Local Currency | USD | - | 92.108.674 |
| Emerging Markets Equity | USD | 13.929.387 | 9.419.037 |
| European High Yield Bond | EUR | 70.845.614 | - |
| Event Driven | USD | 32.980.130 | 37.400.725 |
| Global Diversified Income FMP – 2024 | USD | - | 26.905.692 |
| Global Equity Megatrends | USD | 38.727.635 | 12.658.089 |
| Global Real Estate Securities | USD | 2.791.772 | 1.532.456 |
| Global Sustainable Equity | USD | - | 9.044.273 |
| Global Sustainable Value | USD | - | 4.742.899 |
| High Yield Bond | USD | - | 126.843.853 |
| Japan Equity Engagement | JPY | - | 845.674.038 |
| Macro Opportunities FX | EUR | - | 2.932.820 |
| Next Generation Mobility | USD | - | 22.827.677 |
| Next Generation Space Economy | USD | 5.816.891 | - |
| Short Duration Emerging Market Debt | USD | 198.879.641 | 358.656.136 |
| Short Duration High Yield SDG Engagement | USD | 53.050.191 | 78.079.994 |
| Strategic Income | USD | 1.012.761.457 | 239.521.633 |
| Sustainable Emerging Market Corporate Debt | USD | 8.054.980 | - |
| Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency | USD | 72.294.173 | - |
| Tactical Macro | USD | 5.280.247 | - |
| Ultra Short Term Euro Bond | EUR | 193.377.608 | 133.963.573 |
| Uncorrelated Strategies | USD | 88.020.268 | 530.263.251 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

22. WESENTLICHE EREIGNISSE SEIT DEM ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES (FORTSETZUNG)

| Portfolio | Währung | Zeichnungen | Rücknahmen |
|----------------------------|---------|-------------|---------------|
| US Equity | USD | 33.832.093 | 15.230.335 |
| US Equity Index PutWrite | USD | 101.970.279 | - |
| US Large Cap Value | USD | 115.443.922 | 1.016.897.730 |
| US Long Short Equity | USD | 10.329.869 | 15.267.097 |
| US Multi Cap Opportunities | USD | 25.486.747 | 105.779.067 |
| US Real Estate Securities | USD | - | 56.901.186 |
| US Small Cap | USD | 114.251.542 | 163.467.499 |

Außer den oben erwähnten sind seit Jahresende keine wesentlichen, den Fonds betreffenden Ereignisse eingetreten.

23. GENEHMIGUNG DES ABSCHLUSSES

Die Direktoren haben den Jahresbericht und den geprüften Jahresabschluss am 17. April 2024 genehmigt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN

Der Manager des Fonds ist ein verbundenes Unternehmen von Neuberger Berman Investment Advisers LLC, einem bei der Securities Exchange Commission („SEC“) in den USA registrierten Anlageberater. Die hierin enthaltenen Informationen spiegeln die den allgemein anerkannten Bilanzierungsgrundsätzen der USA („US GAAP“) entsprechenden Offenlegungen wider, so dass der Manager von bestimmten Ausnahmen Gebrauch machen kann, die ihm gemäß SEC Custody Rule zur Verfügung stehen.

5G Connectivity

| | Thesaurierende Klasse AUD A AUD | Thesaurierende Klasse AUD I2* AUD | Thesaurierende Klasse CHF A* CHF | Thesaurierende Klasse CHF I* CHF | Thesaurierende Klasse CHF I2* CHF | Thesaurierende Klasse CNY A CNY |
|--|---------------------------------------|---|--|--|---|---------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 7,98 | 10,00 | 10,00 | 10,00 | 10,00 | 57,01 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,11) | 0,00 | (0,05) | (0,02) | 0,00 | (0,80) |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 2,90 | 1,32 | 0,67 | 0,67 | 1,37 | 20,30 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 2,79 | 1,32 | 0,62 | 0,65 | 1,37 | 19,50 |
| Schlussnettoinventarwert | 10,77 | 11,32 | 10,62 | 10,65 | 11,37 | 76,51 |
| Gesamtertrag | 34,96 % | 13,20 % | 6,20 % | 6,50 % | 13,70 % | 34,20 % |

Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen

| | | | | | | |
|--------------------------------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,79 % | 0,80 % | 1,76 % | 0,95 % | 0,79 % | 1,84 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (1,18 %) | (0,15 %) | (1,20 %) | (0,39 %) | (0,15 %) | (1,23 %) |

31. Dezember 2022

| | | | | | | |
|--|-----------|---|---|---|---|-----------|
| Eröffnungsnettoinventarwert | 14,75 | – | – | – | – | 101,38 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,14) | – | – | – | – | (1,01) |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (6,63) | – | – | – | – | (43,36) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (6,77) | – | – | – | – | (44,37) |
| Schlussnettoinventarwert | 7,98 | – | – | – | – | 57,01 |
| Gesamtertrag | (45,90 %) | – | – | – | – | (43,77 %) |

Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen

| | | | | | | |
|--------------------------------|----------|---|---|---|---|----------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,85 % | – | – | – | – | 1,86 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (1,39 %) | – | – | – | – | (1,41 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

5G Connectivity (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse CNY I2* | Thesaurierende Klasse EUR A | Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) | Thesaurierende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | Thesaurierende Klasse EUR I2* |
|---|----------------------------------|--------------------------------|---|--------------------------------|---|----------------------------------|
| | CNY | € | € | € | € | € |
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 100,00 | 8,32 | 9,34 | 7,73 | 9,01 | 10,00 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,05) | (0,11) | (0,13) | (0,03) | (0,04) | 0,00 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 13,47 | 3,01 | 3,27 | 2,80 | 3,17 | 1,32 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 13,42 | 2,90 | 3,14 | 2,77 | 3,13 | 1,32 |
| Schlussnettoinventarwert | 113,42 | 11,22 | 12,48 | 10,50 | 12,14 | 11,32 |
| Gesamtertrag | 13,42 % | 34,86 % | 33,62 % | 35,83 % | 34,74 % | 13,20 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,82 % | 1,80 % | 1,80 % | 0,97 % | 0,96 % | 0,81 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,16 %) | (1,20 %) | (1,19 %) | (0,36 %) | (0,37 %) | (0,15 %) |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | – | 15,39 | 15,55 | 14,16 | 14,87 | – |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | – | (0,15) | (0,15) | (0,05) | (0,06) | – |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | – | (6,92) | (6,06) | (6,38) | (5,80) | – |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | – | (7,07) | (6,21) | (6,43) | (5,86) | – |
| Schlussnettoinventarwert | – | 8,32 | 9,34 | 7,73 | 9,01 | – |
| Gesamtertrag | – | (45,94 %) | (39,94 %) | (45,41 %) | (39,41 %) | – |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | – | 1,78 % | 1,78 % | 0,95 % | 0,95 % | – |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | – | (1,35 %) | (1,32 %) | (0,50 %) | (0,50 %) | – |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

5G Connectivity (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse EUR I5 | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | Thesaurierende Klasse GBP A | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | Thesaurierende Klasse GBP I2* | Thesaurierende Klasse HKD A |
|---|---------------------------------|--|--------------------------------|---|----------------------------------|--------------------------------|
| | € | € | £ | £ | £ | HKD |
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 6,97 | 9,14 | 8,45 | 7,81 | 10,00 | 8,80 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,02) | (0,21) | (0,12) | (0,03) | 0,00 | (0,13) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 2,56 | 3,18 | 3,24 | 2,50 | 1,37 | 3,37 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 2,54 | 2,97 | 3,12 | 2,47 | 1,37 | 3,24 |
| Schlussnettoinventarwert | 9,51 | 12,11 | 11,57 | 10,28 | 11,37 | 12,04 |
| Gesamtertrag | 36,44 % | 32,49 % | 36,92 % | 31,63 % | 13,70 % | 36,82 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,57 % | 2,58 % | 1,79 % | 0,96 % | 0,81 % | 1,83 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,32 %) | (1,97 %) | (1,19 %) | (0,39 %) | (0,15 %) | (1,23 %) |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 12,72 | 15,33 | 15,43 | 12,20 | – | 15,70 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,01) | (0,24) | (0,15) | (0,05) | – | (0,15) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (5,74) | (5,95) | (6,83) | (4,34) | – | (6,75) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (5,75) | (6,19) | (6,98) | (4,39) | – | (6,90) |
| Schlussnettoinventarwert | 6,97 | 9,14 | 8,45 | 7,81 | – | 8,80 |
| Gesamtertrag | (45,20 %) | (40,38 %) | (45,24 %) | (35,98 %) | – | (43,95 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,53 % | 2,57 % | 1,86 % | 0,99 % | – | 1,81 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,10 %) | (2,11 %) | (1,40 %) | (0,52 %) | – | (1,35 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

5G Connectivity (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse HKD I2* HKD | Thesaurierende Klasse SGD A SGD | Thesaurierende Klasse SGD I2* SGD | Thesaurierende Klasse USD A US\$ | Thesaurierende Klasse USD E* US\$ | Thesaurierende Klasse USD I US\$ |
|---|---|---------------------------------------|---|--|---|--|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,00 | 17,27 | 20,00 | 9,12 | 10,00 | 9,79 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,00 | (0,24) | (0,01) | (0,13) | (0,22) | (0,04) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 1,39 | 6,44 | 2,68 | 3,61 | 2,14 | 3,90 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1,39 | 6,20 | 2,67 | 3,48 | 1,92 | 3,86 |
| Schlussnettoinventarwert | 11,39 | 23,47 | 22,67 | 12,60 | 11,92 | 13,65 |
| Gesamtertrag | 13,90 % | 35,90 % | 13,35 % | 38,16 % | 19,20 % | 39,43 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,83 % | 1,80 % | 0,81 % | 1,83 % | 2,94 % | 0,99 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,16 %) | (1,20 %) | (0,16 %) | (1,22 %) | (2,31 %) | (0,38 %) |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | – | 31,05 | – | 16,17 | – | 17,22 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | – | (0,28) | – | (0,15) | – | (0,06) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | – | (13,50) | – | (6,90) | – | (7,37) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | – | (13,78) | – | (7,05) | – | (7,43) |
| Schlussnettoinventarwert | – | 17,27 | – | 9,12 | – | 9,79 |
| Gesamtertrag | – | (44,38 %) | – | (43,60 %) | – | (43,15 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | – | 1,76 % | – | 1,81 % | – | 0,96 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | – | (1,32 %) | – | (1,36 %) | – | (0,53 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

5G Connectivity (Fortsetzung)

| | Ausschüttende Klasse USD I US\$ | Thesaurierende Klasse USD I2 US\$ | Thesaurierende Klasse USD I3 US\$ | Thesaurierende Klasse USD I5 US\$ | Thesaurierende Klasse USD M US\$ | Thesaurierende Klasse USD Z US\$ |
|--|---------------------------------------|---|---|---|--|--|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,79 | 6,26 | 6,65 | 9,07 | 8,04 | 6,24 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,04) | (0,01) | (0,01) | 0,01 | (0,19) | 0,04 |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 3,90 | 2,49 | 2,66 | 3,62 | 3,17 | 2,50 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 3,86 | 2,48 | 2,65 | 3,63 | 2,98 | 2,54 |
| Schlussnettoinventarwert | 13,65 | 8,74 | 9,30 | 12,70 | 11,02 | 8,78 |
| Gesamtertrag | 39,43 % | 39,62 % | 39,85 % | 40,02 % | 37,06 % | 40,71 % |

Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen

| | | | | | | |
|--------------------------------|----------|----------|----------|--------|----------|--------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,99 % | 0,81 % | 0,73 % | 0,56 % | 2,64 % | 0,14 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,37 %) | (0,21 %) | (0,11 %) | 0,06 % | (2,02 %) | 0,48 % |

31. Dezember 2022

| | | | | | | |
|--|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| Eröffnungsnettoinventarwert | 17,21 | 10,98 | 11,67 | 15,89 | 14,37 | 10,88 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,06) | (0,02) | (0,02) | (0,01) | (0,21) | 0,03 |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (7,36) | (4,70) | (5,00) | (6,81) | (6,12) | (4,67) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (7,42) | (4,72) | (5,02) | (6,82) | (6,33) | (4,64) |
| Schlussnettoinventarwert | 9,79 | 6,26 | 6,65 | 9,07 | 8,04 | 6,24 |
| Gesamtertrag | (43,11 %) | (42,99 %) | (43,02 %) | (42,92 %) | (44,05 %) | (42,65 %) |

Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen

| | | | | | | |
|--------------------------------|----------|----------|----------|----------|----------|--------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,96 % | 0,79 % | 0,71 % | 0,54 % | 2,61 % | 0,11 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,51 %) | (0,33 %) | (0,24 %) | (0,12 %) | (2,15 %) | 0,36 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

5G Connectivity (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse ZAR A* ZAR | Thesaurierende Klasse ZAR E* ZAR |
|---|--|--|
| 31. Dezember 2023 | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 100,00 | 100,00 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (1,08) | (2,20) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 26,71 | 28,45 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 25,63 | 26,25 |
| Schlussnettoinventarwert | 125,63 | 126,25 |
| Gesamtertrag | 25,63 % | 26,25 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,78 % | 2,85 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (1,12 %) | (2,22 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

China A-Share Equity

| | Thesaurierende Klasse CNY I | Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) | Ausschüttende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) |
|--|--------------------------------|---|--|
| | CNY | US\$ | US\$ |
| 31. Dezember 2023 | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 91,62 | 9,28 | 9,27 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,60 | 0,06 | 0,06 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (11,88) | (1,44) | (1,43) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (11,28) | (1,38) | (1,37) |
| Ausschüttungen | – | – | (0,01) |
| Schlussnettoinventarwert | 80,34 | 7,90 | 7,89 |
| Gesamtertrag | (12,31 %) | (14,87 %) | (14,81 %) |

**Verhältnis zum durchschnittlichen
Nettovermögen**

| | | | |
|--------------------------------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,22 % | 1,21 % | 1,21 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,68 % | 0,68 % | 0,68 % |

31. Dezember 2022

| | | | |
|--|-----------|-----------|-----------|
| Eröffnungsnettoinventarwert | 118,49 | 13,05 | 13,05 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,09 | 0,03 | 0,01 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (26,96) | (3,80) | (3,79) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (26,87) | (3,77) | (3,78) |
| Schlussnettoinventarwert | 91,62 | 9,28 | 9,27 |
| Gesamtertrag | (22,68 %) | (28,89 %) | (28,97 %) |

**Verhältnis zum durchschnittlichen
Nettovermögen**

| | | | |
|--------------------------------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,22 % | 1,18 % | 1,18 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,09 % | 0,27 % | 0,09 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

China Bond

| | Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse CNY I** | Thesaurierende Klasse CNY Z | Thesaurierende Klasse GBP I2 | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) (nicht währungsgesichert) | Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) |
|--|--|---------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|---|---|
| | CNY | CNY | CNY | £ | SGD | US\$ |
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 78,36 | 89,19 | 114,82 | 9,00 | 14,69 | 10,22 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 1,15 | 1,93 | 3,28 | 0,20 | 0,21 | 0,22 |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,94 | 1,08 | 1,37 | 0,31 | (0,47) | (0,17) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 2,09 | 3,01 | 4,65 | 0,51 | (0,26) | 0,05 |
| Ausschüttungen | (3,90) | (1,59) | – | – | (0,72) | – |
| Schlussnettoinventarwert | 76,55 | 90,61 | 119,47 | 9,51 | 13,71 | 10,27 |
| Gesamtertrag | 2,70 % | 3,39 % | 4,05 % | 5,67 % | (1,88 %) | 0,49 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,53 % | 0,88 % | 0,23 % | 0,73 % | 1,51 % | 0,88 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 1,49 % | 2,14 % | 2,79 % | 2,20 % | 1,46 % | 2,14 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 89,21 | 88,94 | 121,51 | 9,69 | 18,30 | 11,85 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 1,42 | 0,07 | 3,54 | 0,24 | 0,28 | 0,26 |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (7,23) | 0,18 | (10,23) | (0,93) | (2,89) | (1,89) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (5,81) | 0,25 | (6,69) | (0,69) | (2,61) | (1,63) |
| Ausschüttungen | (5,04) | – | – | – | (1,00) | – |
| Schlussnettoinventarwert | 78,36 | 89,19 | 114,82 | 9,00 | 14,69 | 10,22 |
| Gesamtertrag | (6,70 %) | 0,25 %*** | (5,51 %) | (7,12 %) | (14,73 %) | (13,76 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,57 % | 0,86 % | 0,27 % | 0,78 % | 1,45 % | 0,87 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 1,71 % | 2,36 % | 3,00 % | 2,57 % | 1,66 % | 2,40 % |

**Wiederaufnahme der Geschäfte am Dienstag, 12. Dezember 2022.

***Die Gesamtrendite für den Zeitraum von 1. Januar 2022 bis 15. November 2022 betrug (6,18) %.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

China Bond (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD Z US\$ | Thesaurierende Klasse USD Z (nicht währungsgesichert) US\$ |
|---|--|---|
| 31. Dezember 2023 | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,49 | 9,78 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,27 | 0,27 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,38 | (0,17) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,65 | 0,10 |
| Schlussnettoinventarwert | 10,14 | 9,88 |
| Gesamtertrag | 6,85 % | 1,02 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen
Nettovermögen**

| | | |
|--------------------------------|--------|--------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,23 % | 0,23 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,77 % | 2,77 % |

31. Dezember 2022

| | | |
|---|----------|-----------|
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,13 | 11,26 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,28 | 0,30 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (0,92) | (1,78) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (0,64) | (1,48) |
| Schlussnettoinventarwert | 9,49 | 9,78 |
| Gesamtertrag | (6,32 %) | (13,14 %) |

**Verhältnis zum durchschnittlichen
Nettovermögen**

| | | |
|--------------------------------|--------|--------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,26 % | 0,26 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,92 % | 2,92 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

China Equity

| | Thesaurierende Klasse CHF I CHF | Thesaurierende Klasse EUR A € | Thesaurierende Klasse EUR I € | Thesaurierende Klasse EUR Z € | Ausschüttende Klasse GBP A £ | Thesaurierende Klasse SGD A SGD |
|---|---------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|---------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 12,23 | 21,49 | 23,33 | 18,02 | 10,70 | 30,18 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,09 | 0,01 | 0,16 | 0,30 | 0,01 | 0,01 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (3,21) | (5,32) | (5,80) | (4,50) | (2,52) | (7,29) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (3,12) | (5,31) | (5,64) | (4,20) | (2,51) | (7,28) |
| Ausschüttungen | – | – | – | – | (0,04) | – |
| Schlussnettoinventarwert | 9,11 | 16,18 | 17,69 | 13,82 | 8,15 | 22,90 |
| Gesamtertrag | (25,51 %) | (24,71 %) | (24,17 %) | (23,31 %) | (23,54 %) | (24,12 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,21 % | 2,00 % | 1,27 % | 0,18 % | 1,98 % | 2,01 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,85 % | 0,07 % | 0,78 % | 1,86 % | 0,06 % | 0,03 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 16,10 | 28,39 | 30,58 | 23,36 | 13,93 | 39,04 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,14 | 0,10 | 0,29 | 0,42 | (0,20) | 0,11 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (4,01) | (7,00) | (7,54) | (5,76) | (3,03) | (8,97) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (3,87) | (6,90) | (7,25) | (5,34) | (3,23) | (8,86) |
| Schlussnettoinventarwert | 12,23 | 21,49 | 23,33 | 18,02 | 10,70 | 30,18 |
| Gesamtertrag | (24,04 %) | (24,30 %) | (23,71 %) | (22,86 %) | (23,19 %) | (22,69 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,20 % | 1,96 % | 1,22 % | 0,12 % | 2,04 % | 1,94 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 1,06 % | 0,41 % | 1,15 % | 2,19 % | (1,39 %) | 0,35 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

China Equity (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD A US\$ | Ausschüttende Klasse USD A US\$ | Thesaurierende Klasse USD I US\$ | Thesaurierende Klasse USD I2 US\$ | Thesaurierende Klasse USD M US\$ | Thesaurierende Klasse USD U US\$ |
|---|--|---------------------------------------|--|---|--|--|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 25,67 | 15,80 | 27,95 | 17,28 | 14,88 | 17,93 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,00 | 0,01 | 0,23 | 0,13 | (0,13) | 0,08 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (5,86) | (3,60) | (6,44) | (3,94) | (3,37) | (4,11) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (5,86) | (3,59) | (6,21) | (3,81) | (3,50) | (4,03) |
| Ausschüttungen | – | (0,06) | – | – | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 19,81 | 12,15 | 21,74 | 13,47 | 11,38 | 13,90 |
| Gesamtertrag | (22,83 %) | (22,81 %) | (22,22 %) | (22,05 %) | (23,52 %) | (22,48 %) |

**Verhältnis zum durchschnittlichen
Nettovermögen**

| | | | | | | |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|----------|--------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 2,04 % | 2,05 % | 1,29 % | 1,08 % | 3,03 % | 1,64 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,01 % | 0,04 % | 0,89 % | 0,83 % | (0,96 %) | 0,50 % |

31. Dezember 2022

| | | | | | | |
|---|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| Eröffnungsnettoinventarwert | 32,88 | 20,24 | 35,53 | 21,91 | 19,25 | 22,88 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,10 | 0,06 | 0,33 | 0,24 | 0,02 | 0,15 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (7,31) | (4,50) | (7,91) | (4,87) | (4,39) | (5,10) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (7,21) | (4,44) | (7,58) | (4,63) | (4,37) | (4,95) |
| Schlussnettoinventarwert | 25,67 | 15,80 | 27,95 | 17,28 | 14,88 | 17,93 |
| Gesamtertrag | (21,93 %) | (21,94 %) | (21,33 %) | (21,13 %) | (22,70 %) | (21,63 %) |

**Verhältnis zum durchschnittlichen
Nettovermögen**

| | | | | | | |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,99 % | 1,99 % | 1,24 % | 1,02 % | 3,00 % | 1,59 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,36 % | 0,35 % | 1,14 % | 1,35 % | 0,14 % | 0,78 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

China Equity (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD Z US\$ |
|---|--|
| 31. Dezember 2023 | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 18,83 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,32 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (4,34) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (4,02) |
| Schlussnettoinventarwert | 14,81 |
| Gesamtertrag | (21,35 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,19 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 1,88 % |
| 31. Dezember 2022 | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 23,68 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,44 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (5,29) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (4,85) |
| Schlussnettoinventarwert | 18,83 |
| Gesamtertrag | (20,48 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,14 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,23 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Climate Innovation¹

| | Thesaurierende Klasse USD A* US\$ | Thesaurierende Klasse USD I* US\$ | Thesaurierende Klasse USD I5* US\$ | Thesaurierende Klasse USD Z* US\$ |
|---|---|---|--|---|
| 31. Dezember 2023 | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,00 | 10,00 | 10,00 | 10,00 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,04) | (0,01) | 0,01 | 0,02 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (0,30) | (0,29) | (0,30) | (0,29) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (0,34) | (0,30) | (0,29) | (0,27) |
| Schlussnettoinventarwert | 9,66 | 9,70 | 9,71 | 9,73 |
| Gesamtertrag | (3,40 %) | (3,00 %) | (2,90 %) | (2,70 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,56 % | 0,71 % | 0,28 % | (0,14 %) |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,74 %) | 0,11 % | 0,54 % | 0,96 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

CLO Income

| | Thesaurierende Klasse EUR A € | Thesaurierende Klasse EUR I € | Ausschüttende Klasse EUR I2 € | Thesaurierende Klasse GBP Z £ | Thesaurierende Klasse SEK I SEK | Thesaurierende Klasse USD A US\$ |
|---|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,67 | 10,23 | 7,90 | 10,84 | 104,04 | 9,83 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 1,00 | 1,17 | 0,86 | 1,32 | 11,41 | 1,06 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,77 | 0,80 | 0,58 | 0,93 | 8,74 | 0,98 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1,77 | 1,97 | 1,44 | 2,25 | 20,15 | 2,04 |
| Ausschüttungen | – | – | (0,82) | – | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 11,44 | 12,20 | 8,52 | 13,09 | 124,19 | 11,87 |
| Gesamtertrag | 18,30 % | 19,26 % | 19,33 % | 20,76 % | 19,37 % | 20,75 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,62 % | 0,90 % | 0,74 % | 0,16 % | 0,86 % | 1,65 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 9,66 % | 10,36 % | 10,65 % | 11,11 % | 10,11 % | 9,86 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,00 | 11,21 | 9,24 | 11,60 | 113,40 | 10,00 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,43 | 0,83 | 0,62 | 0,89 | 8,01 | 0,45 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (0,76) | (1,81) | (1,41) | (1,65) | (17,37) | (0,62) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (0,33) | (0,98) | (0,79) | (0,76) | (9,36) | (0,17) |
| Ausschüttungen | – | – | (0,55) | – | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 9,67 | 10,23 | 7,90 | 10,84 | 104,04 | 9,83 |
| Gesamtertrag | (3,30 %) | (8,74 %) | (8,68 %) | (6,55 %) | (8,25 %) | (1,70 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,52 % | 0,86 % | 0,71 % | 0,13 % | 0,89 % | 1,60 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 7,87 % | 7,77 % | 7,34 % | 7,93 % | 7,43 % | 8,33 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

CLO Income (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD I US\$ | Ausschüttende Klasse USD I* US\$ | Ausschüttende Klasse USD I2 US\$ | Ausschüttende Klasse USD I5 US\$ | Thesaurierende Klasse USD Z US\$ |
|---|--|--|--|--|--|
| 31. Dezember 2023 | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 11,19 | 10,00 | 9,09 | 8,65 | 11,53 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 1,34 | 0,41 | 1,02 | 0,99 | 1,45 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 1,09 | 0,18 | 0,84 | 0,80 | 1,17 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 2,43 | 0,59 | 1,86 | 1,79 | 2,62 |
| Ausschüttungen | – | (0,17) | (0,96) | (0,93) | – |
| Schlussnettoinventarwert | 13,62 | 10,42 | 9,99 | 9,51 | 14,15 |
| Gesamtertrag | 21,72 % | 5,97 % | 21,73 % | 22,04 % | 22,72 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen
Nettovermögen**

| | | | | | |
|--------------------------------|---------|---------|---------|---------|---------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,93 % | 0,97 % | 0,76 % | 0,53 % | 0,16 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 10,59 % | 10,86 % | 10,80 % | 11,07 % | 11,40 % |

31. Dezember 2022

| | | | | | |
|---|----------|---|----------|----------|----------|
| Eröffnungsnettoinventarwert | 12,02 | – | 10,40 | 9,89 | 12,30 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,82 | – | 0,73 | 0,70 | 0,95 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,65) | – | (1,43) | (1,34) | (1,72) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (0,83) | – | (0,70) | (0,64) | (0,77) |
| Ausschüttungen | – | – | (0,61) | (0,60) | – |
| Schlussnettoinventarwert | 11,19 | – | 9,09 | 8,65 | 11,53 |
| Gesamtertrag | (6,91 %) | – | (6,82 %) | (6,54 %) | (6,26 %) |

**Verhältnis zum durchschnittlichen
Nettovermögen**

| | | | | | |
|--------------------------------|--------|---|--------|--------|--------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,87 % | – | 0,71 % | 0,49 % | 0,11 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 7,19 % | – | 7,71 % | 7,79 % | 8,17 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Commodities²

| | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) £ | Thesaurierende Klasse GBP I5 £ | Thesaurierende Klasse USD A US\$ | Thesaurierende Klasse USD I US\$ | Thesaurierende Klasse USD I5 US\$ | Thesaurierende Klasse USD M US\$ |
|---|--|--------------------------------------|--|--|---|--|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,43 | 9,42 | 9,71 | 11,20 | 9,78 | 8,91 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,22 | 0,20 | 0,10 | 0,22 | 0,21 | 0,05 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,45) | (0,88) | (0,81) | (0,95) | (0,82) | (0,75) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,23) | (0,68) | (0,71) | (0,73) | (0,61) | (0,70) |
| Schlussnettoinventarwert | 9,20 | 8,74 | 9,00 | 10,47 | 9,17 | 8,21 |
| Gesamtertrag | (11,79 %) | (7,22 %) | (7,31 %) | (6,52 %) | (6,24 %) | (7,86 %) |

**Verhältnis zum durchschnittlichen
Nettovermögen**

| | | | | | | |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,85 % | 0,53 % | 1,61 % | 0,86 % | 0,54 % | 2,22 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,27 % | 2,26 % | 1,10 % | 2,04 % | 2,22 % | 0,54 % |

31. Dezember 2022

| | | | | | | |
|---|--------|----------|----------|---------|----------|-----------|
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,00 | 10,00 | 10,00 | 10,00 | 10,00 | 10,00 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,01 | 0,07 | (0,01) | (0,01) | 0,06 | (0,05) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,42 | (0,65) | (0,28) | 1,21 | (0,28) | (1,04) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,43 | (0,58) | (0,29) | 1,20 | (0,22) | (1,09) |
| Schlussnettoinventarwert | 10,43 | 9,42 | 9,71 | 11,20 | 9,78 | 8,91 |
| Gesamtertrag | 4,30 % | (5,80 %) | (2,90 %) | 12,00 % | (2,20 %) | (10,90 %) |

**Verhältnis zum durchschnittlichen
Nettovermögen**

| | | | | | | |
|--------------------------------|--------|--------|----------|----------|--------|----------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,84 % | 0,53 % | 1,61 % | 0,84 % | 0,53 % | 2,20 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,14 % | 1,03 % | (0,14 %) | (0,08 %) | 0,73 % | (0,84 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Commodities² (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD Z US\$ |
|--|--|
| 31. Dezember 2023 | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 11,32 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,28 |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (0,95) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (0,67) |
| Schlussnettoinventarwert | 10,65 |
| Gesamtertrag | (5,92 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,21 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,54 % |
| 31. Dezember 2022 | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,00 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,12 |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 1,20 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1,32 |
| Schlussnettoinventarwert | 11,32 |
| Gesamtertrag | 11,64 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,21 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 1,27 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond

| | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) AUD | Thesaurierende Klasse CHF P CHF | Ausschüttende Klasse CHF P CHF | Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) € | Thesaurierende Klasse EUR A € | Thesaurierende Klasse EUR I € |
|--|---|---------------------------------------|--------------------------------------|---|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 7,88 | 9,64 | 8,79 | 7,91 | 10,36 | 11,06 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,24 | 0,33 | 0,31 | 0,25 | 0,33 | 0,43 |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,38 | 0,27 | 0,21 | 0,33 | 0,45 | 0,47 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,62 | 0,60 | 0,52 | 0,58 | 0,78 | 0,90 |
| Ausschüttungen | (0,48) | – | (0,31) | (0,40) | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 8,02 | 10,24 | 9,00 | 8,09 | 11,14 | 11,96 |
| Gesamtertrag | 8,14 % | 6,22 % | 6,09 % | 7,57 % | 7,53 % | 8,14 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,29 % | 0,64 % | 0,64 % | 1,30 % | 1,30 % | 0,70 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,10 % | 3,36 % | 3,59 % | 3,11 % | 3,12 % | 3,74 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,58 | 11,27 | 10,61 | 9,67 | 12,14 | 12,88 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,23 | 0,33 | 0,30 | 0,23 | 0,29 | 0,38 |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,51) | (1,96) | (1,82) | (1,63) | (2,07) | (2,20) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,28) | (1,63) | (1,52) | (1,40) | (1,78) | (1,82) |
| Ausschüttungen | (0,42) | – | (0,30) | (0,36) | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 7,88 | 9,64 | 8,79 | 7,91 | 10,36 | 11,06 |
| Gesamtertrag | (13,56 %) | (14,46 %) | (14,47 %) | (14,72 %) | (14,66 %) | (14,13 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,33 % | 0,64 % | 0,64 % | 1,29 % | 1,29 % | 0,69 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,72 % | 3,17 % | 3,19 % | 2,65 % | 2,64 % | 3,26 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

| | Ausschüttende Klasse EUR I € | Thesaurierende Klasse EUR I2 € | Ausschüttende Klasse EUR I2 € | Thesaurierende Klasse EUR I3 € | Thesaurierende Klasse EUR I5 € | Thesaurierende Klasse EUR M € |
|---|------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 8,98 | 10,20 | 8,19 | 10,30 | 11,30 | 10,88 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,34 | 0,41 | 0,30 | 0,41 | 0,46 | 0,28 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,37 | 0,43 | 0,36 | 0,45 | 0,50 | 0,46 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,71 | 0,84 | 0,66 | 0,86 | 0,96 | 0,74 |
| Ausschüttungen | (0,31) | – | (0,30) | – | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 9,38 | 11,04 | 8,55 | 11,16 | 12,26 | 11,62 |
| Gesamtertrag | 8,17 % | 8,24 % | 8,24 % | 8,35 % | 8,50 % | 6,80 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen
Nettovermögen**

| | | | | | | |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,70 % | 0,58 % | 0,58 % | 0,52 % | 0,40 % | 1,90 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,76 % | 3,87 % | 3,67 % | 3,84 % | 3,94 % | 2,50 % |

31. Dezember 2022

| | | | | | | |
|---|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,80 | 11,86 | 9,85 | 11,97 | 13,12 | 12,82 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,31 | 0,36 | 0,29 | 0,37 | 0,42 | 0,24 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,82) | (2,02) | (1,66) | (2,04) | (2,24) | (2,18) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,51) | (1,66) | (1,37) | (1,67) | (1,82) | (1,94) |
| Ausschüttungen | (0,31) | – | (0,29) | – | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 8,98 | 10,20 | 8,19 | 10,30 | 11,30 | 10,88 |
| Gesamtertrag | (14,14 %) | (14,00 %) | (14,03 %) | (13,95 %) | (13,87 %) | (15,13 %) |

**Verhältnis zum durchschnittlichen
Nettovermögen**

| | | | | | | |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,69 % | 0,57 % | 0,57 % | 0,51 % | 0,39 % | 1,89 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,25 % | 3,36 % | 3,38 % | 3,42 % | 3,59 % | 2,06 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

| | Ausschüttende Klasse EUR M € | Thesaurierende Klasse EUR P € | Ausschüttende Klasse EUR P € | Thesaurierende Klasse GBP I £ | Thesaurierende Klasse GBP I2 £ | Ausschüttende Klasse GBP I2 £ |
|---|------------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|-------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 7,61 | 9,84 | 9,02 | 10,54 | 10,38 | 9,09 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,19 | 0,36 | 0,36 | 0,39 | 0,39 | 0,33 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,32 | 0,45 | 0,35 | 0,65 | 0,65 | 0,55 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,51 | 0,81 | 0,71 | 1,04 | 1,04 | 0,88 |
| Ausschüttungen | (0,32) | – | (0,32) | – | – | (0,33) |
| Schlussnettoinventarwert | 7,80 | 10,65 | 9,41 | 11,58 | 11,42 | 9,64 |
| Gesamtertrag | 6,90 % | 8,23 % | 8,07 % | 9,87 % | 10,02 % | 9,95 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,90 % | 0,67 % | 0,67 % | 0,69 % | 0,58 % | 0,57 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,49 % | 3,58 % | 4,00 % | 3,61 % | 3,66 % | 3,54 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,33 | 11,46 | 10,84 | 12,08 | 11,88 | 10,76 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,17 | 0,34 | 0,32 | 0,37 | 0,38 | 0,33 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,57) | (1,96) | (1,83) | (1,91) | (1,88) | (1,68) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,40) | (1,62) | (1,51) | (1,54) | (1,50) | (1,35) |
| Ausschüttungen | (0,32) | – | (0,31) | – | – | (0,32) |
| Schlussnettoinventarwert | 7,61 | 9,84 | 9,02 | 10,54 | 10,38 | 9,09 |
| Gesamtertrag | (15,17 %) | (14,14 %) | (14,05 %) | (12,75 %) | (12,63 %) | (12,63 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,89 % | 0,66 % | 0,66 % | 0,71 % | 0,59 % | 0,59 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,04 % | 3,18 % | 3,23 % | 3,38 % | 3,48 % | 3,48 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse GBP P £ | Ausschüttende Klasse GBP P £ | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) SGD | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) US\$ | Thesaurierende Klasse USD A US\$ | Ausschüttende Klasse USD A US\$ |
|---|-------------------------------------|------------------------------------|---|--|--|---------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,48 | 8,78 | 16,07 | 8,26 | 11,18 | 8,44 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,35 | 0,33 | 0,50 | 0,26 | 0,37 | 0,27 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,59 | 0,52 | 0,79 | 0,51 | 0,72 | 0,53 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,94 | 0,85 | 1,29 | 0,77 | 1,09 | 0,80 |
| Ausschüttungen | – | (0,31) | (0,96) | (0,54) | – | (0,25) |
| Schlussnettoinventarwert | 10,42 | 9,32 | 16,40 | 8,49 | 12,27 | 8,99 |
| Gesamtertrag | 9,92 % | 9,96 % | 8,32 % | 9,73 % | 9,75 % | 9,67 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,67 % | 0,67 % | 1,31 % | 1,33 % | 1,33 % | 1,32 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,56 % | 3,71 % | 3,13 % | 3,16 % | 3,18 % | 3,19 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,86 | 10,40 | 19,43 | 9,96 | 12,82 | 9,93 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,34 | 0,32 | 0,45 | 0,24 | 0,31 | 0,24 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,72) | (1,64) | (2,95) | (1,49) | (1,95) | (1,51) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,38) | (1,32) | (2,50) | (1,25) | (1,64) | (1,27) |
| Ausschüttungen | – | (0,30) | (0,86) | (0,45) | – | (0,22) |
| Schlussnettoinventarwert | 9,48 | 8,78 | 16,07 | 8,26 | 11,18 | 8,44 |
| Gesamtertrag | (12,71 %) | (12,77 %) | (13,05 %) | (12,77 %) | (12,79 %) | (12,83 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,68 % | 0,68 % | 1,27 % | 1,30 % | 1,30 % | 1,30 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,42 % | 3,42 % | 2,61 % | 2,68 % | 2,68 % | 2,70 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD C1 US\$ | Thesaurierende Klasse USD I US\$ | Ausschüttende Klasse USD I US\$ | Thesaurierende Klasse USD I2 US\$ | Ausschüttende Klasse USD I2 US\$ | Thesaurierende Klasse USD M US\$ |
|---|---|--|---------------------------------------|---|--|--|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,66 | 12,35 | 8,45 | 11,52 | 9,68 | 9,86 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,21 | 0,49 | 0,32 | 0,47 | 0,39 | 0,26 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,63 | 0,79 | 0,54 | 0,75 | 0,59 | 0,64 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,84 | 1,28 | 0,86 | 1,22 | 0,98 | 0,90 |
| Ausschüttungen | – | – | (0,30) | – | (0,35) | – |
| Schlussnettoinventarwert | 10,50 | 13,63 | 9,01 | 12,74 | 10,31 | 10,76 |
| Gesamtertrag | 8,70 % | 10,36 % | 10,44 % | 10,59 % | 10,45 % | 9,13 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 2,35 % | 0,71 % | 0,72 % | 0,59 % | 0,59 % | 1,94 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,08 % | 3,78 % | 3,73 % | 3,89 % | 3,91 % | 2,54 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 11,19 | 14,08 | 9,94 | 13,12 | 11,39 | 11,38 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,17 | 0,41 | 0,29 | 0,38 | 0,35 | 0,21 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,70) | (2,14) | (1,50) | (1,98) | (1,73) | (1,73) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,53) | (1,73) | (1,21) | (1,60) | (1,38) | (1,52) |
| Ausschüttungen | – | – | (0,28) | – | (0,33) | – |
| Schlussnettoinventarwert | 9,66 | 12,35 | 8,45 | 11,52 | 9,68 | 9,86 |
| Gesamtertrag | (13,67 %) | (12,29 %) | (12,28 %) | (12,20 %) | (12,20 %) | (13,36 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 2,32 % | 0,69 % | 0,70 % | 0,57 % | 0,57 % | 1,91 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 1,67 % | 3,22 % | 3,32 % | 3,20 % | 3,52 % | 2,07 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

| | Ausschüttende Klasse USD M US\$ | Thesaurierende Klasse USD P US\$ | Thesaurierende Klasse USD Z US\$ |
|---|---------------------------------------|--|--|
| 31. Dezember 2023 | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 8,23 | 11,00 | 11,84 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,21 | 0,43 | 0,54 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,51 | 0,71 | 0,77 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,72 | 1,14 | 1,31 |
| Ausschüttungen | (0,35) | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 8,60 | 12,14 | 13,15 |
| Gesamtertrag | 9,01 % | 10,36 % | 11,06 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,94 % | 0,69 % | 0,10 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,55 % | 3,74 % | 4,41 % |
| 31. Dezember 2022 | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,87 | 12,54 | 13,42 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,18 | 0,37 | 0,48 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,48) | (1,91) | (2,06) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,30) | (1,54) | (1,58) |
| Ausschüttungen | (0,34) | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 8,23 | 11,00 | 11,84 |
| Gesamtertrag | (13,35 %) | (12,28 %) | (11,77 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,91 % | 0,66 % | 0,09 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,08 % | 3,23 % | 3,97 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Developed Market FMP – 2027¹

| | Thesaurierende Klasse EUR A* | Ausschüttende Klasse EUR I* | Thesaurierende Klasse USD A* | Ausschüttende Klasse USD A* | Thesaurierende Klasse USD I* | Ausschüttende Klasse USD I |
|---|---------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|-------------------------------|
| | € | € | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,00 | 10,00 | 10,00 | 10,00 | 10,00 | 10,00 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,14 | 0,11 | 0,15 | 0,15 | 0,16 | 0,14 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,17 | 0,27 | 0,23 | 0,23 | 0,24 | 0,34 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,31 | 0,38 | 0,38 | 0,38 | 0,40 | 0,48 |
| Schlussnettoinventarwert | 10,31 | 10,38 | 10,38 | 10,38 | 10,40 | 10,48 |
| Gesamtertrag | 3,10 % | 3,80 % | 3,80 % | 3,80 % | 4,00 % | 4,80 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,77 % | 0,39 % | 0,78 % | 0,79 % | 0,44 % | 0,41 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,40 % | 3,89 % | 3,54 % | 3,51 % | 3,81 % | 3,95 % |

| | Thesaurierende Klasse USD X* | Ausschüttende Klasse USD X* |
|---|---------------------------------|--------------------------------|
| | US\$ | US\$ |
| 31. Dezember 2023 | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,00 | 10,00 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,16 | 0,15 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,23 | 0,24 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,39 | 0,39 |
| Schlussnettoinventarwert | 10,39 | 10,39 |
| Gesamtertrag | 3,90 % | 3,90 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,53 % | 0,54 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,81 % | 3,62 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency

| | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse AUD I | Thesaurierende Klasse CAD I3 (nicht währungsgesichert) | Thesaurierende Klasse CHF I2 | Thesaurierende Klasse CHF P | Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) |
|--|--|-------------------------------|---|---------------------------------|--------------------------------|--|
| | AUD | AUD | CAD | CHF | CHF | € |
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 6,88 | 7,81 | 11,04 | 7,73 | 7,79 | 6,20 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,28 | 0,38 | 0,57 | 0,37 | 0,37 | 0,25 |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,45 | 0,52 | 0,65 | 0,35 | 0,35 | 0,35 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,73 | 0,90 | 1,22 | 0,72 | 0,72 | 0,60 |
| Ausschüttungen | (0,53) | (0,40) | – | – | – | (0,47) |
| Schlussnettoinventarwert | 7,08 | 8,31 | 12,26 | 8,45 | 8,51 | 6,33 |
| Gesamtertrag | 11,27 % | 12,11 % | 11,05 % | 9,31 % | 9,24 % | 10,37 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,47 % | 0,79 % | 0,58 % | 0,62 % | 0,72 % | 1,47 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,11 % | 4,83 % | 4,97 % | 4,72 % | 4,61 % | 4,09 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,17 | 10,32 | 10,00 | 9,80 | 9,89 | 8,36 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,35 | 0,45 | 0,10 | 0,42 | 0,42 | 0,30 |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (2,22) | (2,50) | 0,94 | (2,49) | (2,52) | (2,08) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,87) | (2,05) | 1,04 | (2,07) | (2,10) | (1,78) |
| Ausschüttungen | (0,42) | (0,46) | – | – | – | (0,38) |
| Schlussnettoinventarwert | 6,88 | 7,81 | 11,04 | 7,73 | 7,79 | 6,20 |
| Gesamtertrag | (20,61 %) | (20,07 %) | 10,40 % | (21,12 %) | (21,23 %) | (21,52 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,53 % | 0,82 % | 0,60 % | 0,64 % | 0,74 % | 1,48 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,67 % | 5,38 % | 5,75 % | 5,27 % | 5,13 % | 4,50 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse EUR A | Thesaurierende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | Ausschüttende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR I2 | Ausschüttende Klasse EUR I2 |
|---|--------------------------------|--------------------------------|---|-------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|
| | € | € | € | € | € | € |
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,53 | 10,31 | 8,82 | 6,49 | 7,87 | 6,96 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,40 | 0,51 | 0,43 | 0,31 | 0,40 | 0,34 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,60 | 0,64 | 0,45 | 0,39 | 0,50 | 0,43 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1,00 | 1,15 | 0,88 | 0,70 | 0,90 | 0,77 |
| Ausschüttungen | – | – | – | (0,33) | – | (0,37) |
| Schlussnettoinventarwert | 10,53 | 11,46 | 9,70 | 6,86 | 8,77 | 7,36 |
| Gesamtertrag | 10,49 % | 11,15 % | 9,98 % | 11,36 % | 11,44 % | 11,56 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,48 % | 0,79 % | 0,79 % | 0,79 % | 0,65 % | 0,65 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,09 % | 4,81 % | 4,78 % | 4,79 % | 4,91 % | 4,92 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 12,16 | 13,06 | 10,22 | 8,68 | 9,96 | 9,32 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,45 | 0,58 | 0,45 | 0,36 | 0,44 | 0,40 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (3,08) | (3,33) | (1,85) | (2,17) | (2,53) | (2,34) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (2,63) | (2,75) | (1,40) | (1,81) | (2,09) | (1,94) |
| Ausschüttungen | – | – | – | (0,38) | – | (0,42) |
| Schlussnettoinventarwert | 9,53 | 10,31 | 8,82 | 6,49 | 7,87 | 6,96 |
| Gesamtertrag | (21,63 %) | (21,06 %) | (13,70 %) | (21,04 %) | (20,98 %) | (21,02 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,48 % | 0,79 % | 0,79 % | 0,79 % | 0,65 % | 0,65 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,51 % | 5,13 % | 5,32 % | 5,18 % | 5,31 % | 5,34 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse EUR I3 | Thesaurierende Klasse EUR I4 | Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) | Thesaurierende Klasse EUR M | Ausschüttende Klasse EUR M | Thesaurierende Klasse EUR P |
|---|---------------------------------|---------------------------------|---|--------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|
| | € | € | € | € | € | € |
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 8,83 | 9,97 | 10,00 | 8,95 | 6,16 | 7,98 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,46 | 0,52 | 0,53 | 0,30 | 0,20 | 0,40 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,55 | 0,64 | 0,51 | 0,56 | 0,36 | 0,50 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1,01 | 1,16 | 1,04 | 0,86 | 0,56 | 0,90 |
| Ausschüttungen | – | – | – | – | (0,36) | – |
| Schlussnettoinventarwert | 9,84 | 11,13 | 11,04 | 9,81 | 6,36 | 8,88 |
| Gesamtertrag | 11,44 % | 11,63 % | 10,40 % | 9,61 % | 9,68 % | 11,28 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen
Nettovermögen**

| | | | | | | |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,58 % | 0,51 % | 0,45 % | 2,26 % | 2,26 % | 0,76 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,08 % | 5,08 % | 5,14 % | 3,32 % | 3,32 % | 4,82 % |

31. Dezember 2022

| | | | | | | |
|---|-----------|-----------|--------|-----------|-----------|-----------|
| Eröffnungsnettoinventarwert | 11,16 | 12,60 | 10,00 | 11,51 | 8,44 | 10,11 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,50 | 0,58 | 0,28 | 0,35 | 0,25 | 0,46 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (2,83) | (3,21) | (0,28) | (2,91) | (2,10) | (2,59) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (2,33) | (2,63) | 0,00 | (2,56) | (1,85) | (2,13) |
| Ausschüttungen | – | – | – | – | (0,43) | – |
| Schlussnettoinventarwert | 8,83 | 9,97 | 10,00 | 8,95 | 6,16 | 7,98 |
| Gesamtertrag | (20,88 %) | (20,87 %) | 0,00 % | (22,24 %) | (22,23 %) | (21,07 %) |

**Verhältnis zum durchschnittlichen
Nettovermögen**

| | | | | | | |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,58 % | 0,51 % | 0,43 % | 2,26 % | 2,26 % | 0,75 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,43 % | 5,46 % | 5,64 % | 3,71 % | 3,69 % | 5,12 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse EUR Z € | Thesaurierende Klasse GBP I £ | Ausschüttende Klasse GBP I £ | Thesaurierende Klasse GBP I2 £ | Ausschüttende Klasse GBP I2 £ | Thesaurierende Klasse GBP P £ |
|--|-------------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 8,27 | 9,55 | 6,91 | 8,39 | 7,18 | 8,56 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,46 | 0,48 | 0,34 | 0,42 | 0,35 | 0,43 |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,54 | 0,75 | 0,52 | 0,67 | 0,56 | 0,68 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1,00 | 1,23 | 0,86 | 1,09 | 0,91 | 1,11 |
| Ausschüttungen | – | – | (0,36) | – | (0,38) | – |
| Schlussnettoinventarwert | 9,27 | 10,78 | 7,41 | 9,48 | 7,71 | 9,67 |
| Gesamtertrag | 12,09 % | 12,88 % | 12,97 % | 12,99 % | 13,28 % | 12,97 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,11 % | 0,79 % | 0,78 % | 0,65 % | 0,65 % | 0,75 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,42 % | 4,83 % | 4,84 % | 4,85 % | 4,85 % | 4,87 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,41 | 11,92 | 9,11 | 10,45 | 9,47 | 10,68 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,51 | 0,54 | 0,42 | 0,49 | 0,43 | 0,48 |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (2,65) | (2,91) | (2,21) | (2,55) | (2,28) | (2,60) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (2,14) | (2,37) | (1,79) | (2,06) | (1,85) | (2,12) |
| Ausschüttungen | – | – | (0,41) | – | (0,44) | – |
| Schlussnettoinventarwert | 8,27 | 9,55 | 6,91 | 8,39 | 7,18 | 8,56 |
| Gesamtertrag | (20,56 %) | (19,88 %) | (19,86 %) | (19,71 %) | (19,77 %) | (19,85 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,10 % | 0,82 % | 0,82 % | 0,68 % | 0,68 % | 0,78 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,88 % | 5,39 % | 5,26 % | 5,54 % | 5,53 % | 5,46 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

| | Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) HKD | Thesaurierende Klasse JPY I ¥ | Thesaurierende Klasse SEK A SEK | Thesaurierende Klasse SEK I2 SEK | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) SGD | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) US\$ |
|---|---|-------------------------------------|---------------------------------------|--|---|--|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 7,38 | 816,31 | 91,78 | 77,53 | 13,92 | 6,89 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,31 | 40,64 | 3,85 | 3,93 | 0,57 | 0,29 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,52 | 19,88 | 5,84 | 4,99 | 0,92 | 0,56 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,83 | 60,52 | 9,69 | 8,92 | 1,49 | 0,85 |
| Ausschüttungen | (0,57) | – | – | – | (1,07) | (0,53) |
| Schlussnettoinventarwert | 7,64 | 876,83 | 101,47 | 86,45 | 14,34 | 7,21 |
| Gesamtertrag | 11,87 % | 7,41 % | 10,56 % | 11,51 % | 11,36 % | 13,08 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,51 % | 0,81 % | 1,43 % | 0,63 % | 1,48 % | 1,51 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,22 % | 4,92 % | 4,09 % | 4,93 % | 4,12 % | 4,19 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,73 | 1.033,60 | 116,99 | 98,00 | 18,39 | 9,06 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,36 | 45,90 | 4,52 | 4,77 | 0,66 | 0,34 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (2,26) | (263,19) | (29,73) | (25,24) | (4,29) | (2,09) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,90) | (217,29) | (25,21) | (20,47) | (3,63) | (1,75) |
| Ausschüttungen | (0,45) | – | – | – | (0,84) | (0,42) |
| Schlussnettoinventarwert | 7,38 | 816,31 | 91,78 | 77,53 | 13,92 | 6,89 |
| Gesamtertrag | (19,74 %) | (21,02 %) | (21,55 %) | (20,89 %) | (19,90 %) | (19,53 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,50 % | 0,80 % | 1,55 % | 0,68 % | 1,46 % | 1,50 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,55 % | 5,28 % | 4,76 % | 5,44 % | 4,45 % | 4,56 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD A US\$ | Ausschüttende Klasse USD A US\$ | Thesaurierende Klasse USD C1 US\$ | Thesaurierende Klasse USD I US\$ | Ausschüttende Klasse USD I US\$ | Thesaurierende Klasse USD I2 US\$ |
|--|--|---------------------------------------|---|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 11,26 | 7,74 | 8,45 | 12,04 | 7,70 | 10,45 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,49 | 0,33 | 0,28 | 0,61 | 0,38 | 0,52 |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,98 | 0,64 | 0,73 | 1,06 | 0,64 | 0,94 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1,47 | 0,97 | 1,01 | 1,67 | 1,02 | 1,46 |
| Ausschüttungen | – | (0,35) | – | – | (0,40) | – |
| Schlussnettoinventarwert | 12,73 | 8,36 | 9,46 | 13,71 | 8,32 | 11,91 |
| Gesamtertrag | 13,06 % | 13,01 % | 11,95 % | 13,87 % | 13,87 % | 13,97 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,51 % | 1,51 % | 2,51 % | 0,81 % | 0,81 % | 0,67 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,17 % | 4,23 % | 3,19 % | 4,88 % | 4,90 % | 4,74 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 13,99 | 10,06 | 10,60 | 14,86 | 10,02 | 12,87 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,53 | 0,37 | 0,32 | 0,66 | 0,43 | 0,60 |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (3,26) | (2,32) | (2,47) | (3,48) | (2,31) | (3,02) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (2,73) | (1,95) | (2,15) | (2,82) | (1,88) | (2,42) |
| Ausschüttungen | – | (0,37) | – | – | (0,44) | – |
| Schlussnettoinventarwert | 11,26 | 7,74 | 8,45 | 12,04 | 7,70 | 10,45 |
| Gesamtertrag | (19,51 %) | (19,54 %) | (20,28 %) | (18,98 %) | (18,95 %) | (18,80 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,50 % | 1,50 % | 2,50 % | 0,80 % | 0,80 % | 0,66 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,58 % | 4,62 % | 3,58 % | 5,29 % | 5,26 % | 5,40 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

| | Ausschüttende Klasse USD I2 US\$ | Ausschüttende Klasse USD I3 US\$ | Thesaurierende Klasse USD M US\$ | Ausschüttende Klasse USD M US\$ | Thesaurierende Klasse USD P US\$ | Thesaurierende Klasse USD X US\$ |
|---|--|--|--|---------------------------------------|--|--|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 7,47 | 7,60 | 8,52 | 6,39 | 8,95 | 8,15 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,37 | 0,39 | 0,30 | 0,22 | 0,46 | 0,44 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,63 | 0,64 | 0,74 | 0,52 | 0,78 | 0,71 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1,00 | 1,03 | 1,04 | 0,74 | 1,24 | 1,15 |
| Ausschüttungen | (0,40) | (0,41) | – | (0,38) | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 8,07 | 8,22 | 9,56 | 6,75 | 10,19 | 9,30 |
| Gesamtertrag | 14,00 % | 14,22 % | 12,21 % | 12,26 % | 13,85 % | 14,11 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,67 % | 0,60 % | 2,31 % | 2,31 % | 0,77 % | 0,52 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,93 % | 5,10 % | 3,38 % | 3,39 % | 4,92 % | 5,16 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,71 | 9,89 | 10,67 | 8,52 | 11,03 | 10,03 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,43 | 0,44 | 0,34 | 0,26 | 0,49 | 0,46 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (2,23) | (2,28) | (2,49) | (1,96) | (2,57) | (2,34) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,80) | (1,84) | (2,15) | (1,70) | (2,08) | (1,88) |
| Ausschüttungen | (0,44) | (0,45) | – | (0,43) | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 7,47 | 7,60 | 8,52 | 6,39 | 8,95 | 8,15 |
| Gesamtertrag | (18,74 %) | (18,77 %) | (20,15 %) | (20,22 %) | (18,86 %) | (18,74 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,66 % | 0,59 % | 2,30 % | 2,30 % | 0,77 % | 0,55 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,38 % | 5,50 % | 3,78 % | 3,79 % | 5,31 % | 5,60 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD Z US\$ |
|---|--|
| 31. Dezember 2023 | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,02 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,58 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,89 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1,47 |
| Schlussnettoinventarwert | 11,49 |
| Gesamtertrag | 14,67 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,11 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,58 % |
| 31. Dezember 2022 | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 12,27 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,64 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (2,89) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (2,25) |
| Schlussnettoinventarwert | 10,02 |
| Gesamtertrag | (18,34 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,10 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,77 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency

| | Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) AUD | Thesaurierende Klasse AUD B AUD | Thesaurierende Klasse AUD C2 AUD | Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) AUD | Thesaurierende Klasse AUD E AUD | Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) AUD |
|---|---|---------------------------------------|--|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 3,54 | 7,62 | 7,61 | 3,54 | 7,61 | 3,81 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,10 | 0,23 | 0,23 | 0,10 | 0,23 | 0,15 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,22 | 0,49 | 0,50 | 0,23 | 0,49 | 0,23 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,32 | 0,72 | 0,73 | 0,33 | 0,72 | 0,38 |
| Ausschüttungen | (0,35) | – | – | (0,35) | – | (0,37) |
| Schlussnettoinventarwert | 3,51 | 8,34 | 8,34 | 3,52 | 8,33 | 3,82 |
| Gesamtertrag | 9,48 % | 9,45 % | 9,59 % | 9,79 % | 9,46 % | 10,70 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 2,94 % | 2,92 % | 2,84 % | 2,93 % | 2,92 % | 1,95 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,93 % | 2,93 % | 2,87 % | 2,92 % | 2,92 % | 3,91 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 4,65 | 9,06 | 9,05 | 4,66 | 9,05 | 4,97 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,11 | 0,22 | 0,23 | 0,11 | 0,22 | 0,16 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (0,83) | (1,66) | (1,67) | (0,84) | (1,66) | (0,90) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (0,72) | (1,44) | (1,44) | (0,73) | (1,44) | (0,74) |
| Ausschüttungen | (0,39) | – | – | (0,39) | – | (0,42) |
| Schlussnettoinventarwert | 3,54 | 7,62 | 7,61 | 3,54 | 7,61 | 3,81 |
| Gesamtertrag | (15,78 %) | (15,89 %) | (15,91 %) | (15,97 %) | (15,91 %) | (15,20 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 3,04 % | 3,03 % | 3,03 % | 3,04 % | 3,03 % | 2,00 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,74 % | 2,77 % | 2,57 % | 2,70 % | 2,77 % | 3,84 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse AUD T | Thesaurierende Klasse EUR A | Thesaurierende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert) | Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) |
|--|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|---|---|--|
| | AUD | € | € | € | € | € |
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 8,21 | 6,52 | 6,99 | 9,22 | 10,86 | 7,20 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,34 | 0,28 | 0,36 | 0,48 | 0,58 | 0,39 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,52 | 0,39 | 0,41 | 0,45 | 0,53 | 0,34 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,86 | 0,67 | 0,77 | 0,93 | 1,11 | 0,73 |
| Ausschüttungen | – | – | – | – | – | (0,36) |
| Schlussnettoinventarwert | 9,07 | 7,19 | 7,76 | 10,15 | 11,97 | 7,57 |
| Gesamtertrag | 10,48 % | 10,28 % | 11,02 % | 10,09 % | 10,22 % | 10,41 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,94 % | 1,65 % | 0,93 % | 0,92 % | 0,78 % | 0,63 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,91 % | 4,16 % | 4,92 % | 4,97 % | 5,11 % | 5,26 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,66 | 7,75 | 8,25 | 9,93 | 11,69 | 8,12 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,32 | 0,28 | 0,35 | 0,45 | 0,55 | 0,38 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,77) | (1,51) | (1,61) | (1,16) | (1,38) | (0,93) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,45) | (1,23) | (1,26) | (0,71) | (0,83) | (0,55) |
| Ausschüttungen | – | – | – | – | – | (0,37) |
| Schlussnettoinventarwert | 8,21 | 6,52 | 6,99 | 9,22 | 10,86 | 7,20 |
| Gesamtertrag | (15,01 %) | (15,87 %) | (15,27 %) | (7,15 %) | (7,10 %) | (6,87 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 2,00 % | 1,65 % | 0,90 % | 0,89 % | 0,75 % | 0,60 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,85 % | 3,39 % | 4,69 % | 4,75 % | 4,84 % | 5,05 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse EUR Y (nicht währungsgesichert) | Thesaurierende Klasse GBP I | Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) | Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) | Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert) | Thesaurierende Klasse SEK A |
|---|---|--------------------------------|---|--|---|--------------------------------|
| | € | £ | £ | £ | £ | SEK |
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,22 | 7,65 | 9,67 | 7,20 | 9,22 | 80,46 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,52 | 0,40 | 0,52 | 0,38 | 0,51 | 3,49 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,44 | 0,58 | 0,23 | 0,17 | 0,22 | 4,73 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,96 | 0,98 | 0,75 | 0,55 | 0,73 | 8,22 |
| Ausschüttungen | – | – | – | (0,35) | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 10,18 | 8,63 | 10,42 | 7,40 | 9,95 | 88,68 |
| Gesamtertrag | 10,41 % | 12,81 % | 7,76 % | 7,94 % | 7,92 % | 10,22 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,54 % | 0,94 % | 0,63 % | 0,63 % | 0,54 % | 1,61 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,35 % | 4,95 % | 5,22 % | 5,23 % | 5,34 % | 4,14 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,89 | 8,89 | 9,83 | 7,69 | 9,36 | 95,54 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,48 | 0,39 | 0,50 | 0,38 | 0,49 | 3,50 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,15) | (1,63) | (0,66) | (0,51) | (0,63) | (18,58) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (0,67) | (1,24) | (0,16) | (0,13) | (0,14) | (15,08) |
| Ausschüttungen | – | – | – | (0,36) | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 9,22 | 7,65 | 9,67 | 7,20 | 9,22 | 80,46 |
| Gesamtertrag | (6,77 %) | (13,95 %) | (1,63 %) | (1,63 %) | (1,50 %) | (15,78 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,51 % | 0,93 % | 0,63 % | 0,64 % | 0,54 % | 1,71 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,13 % | 4,93 % | 5,21 % | 5,17 % | 5,29 % | 4,17 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

| | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) SGD | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) US\$ | Thesaurierende Klasse USD A US\$ | Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) US\$ | Thesaurierende Klasse USD B US\$ | Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich) US\$ |
|--|---|--|--|--|--|---|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,66 | 4,73 | 7,78 | 3,97 | 7,99 | 3,97 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,45 | 0,21 | 0,36 | 0,12 | 0,25 | 0,12 |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,71 | 0,38 | 0,65 | 0,32 | 0,67 | 0,32 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1,16 | 0,59 | 1,01 | 0,44 | 0,92 | 0,44 |
| Ausschüttungen | (0,79) | (0,35) | – | (0,39) | – | (0,39) |
| Schlussnettoinventarwert | 11,03 | 4,97 | 8,79 | 4,02 | 8,91 | 4,02 |
| Gesamtertrag | 11,31 % | 12,99 % | 12,98 % | 11,71 % | 11,51 % | 11,71 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,66 % | 1,69 % | 1,69 % | 3,00 % | 3,00 % | 3,01 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,20 % | 4,35 % | 4,33 % | 3,01 % | 3,00 % | 3,05 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 13,26 | 5,84 | 8,99 | 5,14 | 9,36 | 5,14 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,44 | 0,20 | 0,32 | 0,12 | 0,23 | 0,12 |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (2,29) | (0,98) | (1,53) | (0,86) | (1,60) | (0,86) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,85) | (0,78) | (1,21) | (0,74) | (1,37) | (0,74) |
| Ausschüttungen | (0,75) | (0,33) | – | (0,43) | – | (0,43) |
| Schlussnettoinventarwert | 10,66 | 4,73 | 7,78 | 3,97 | 7,99 | 3,97 |
| Gesamtertrag | (14,02 %) | (13,38 %) | (13,46 %) | (14,56 %) | (14,64 %) | (14,56 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,61 % | 1,67 % | 1,66 % | 2,97 % | 2,98 % | 2,97 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,95 % | 4,04 % | 4,07 % | 2,70 % | 2,66 % | 2,70 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

| | Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) | Thesaurierende Klasse USD E | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) | Thesaurierende Klasse USD I | Ausschüttende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD I2 |
|--|--|--------------------------------|--|--------------------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 3,97 | 7,99 | 7,52 | 8,36 | 6,94 | 8,12 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,12 | 0,26 | 0,39 | 0,45 | 0,36 | 0,45 |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,32 | 0,67 | 0,62 | 0,71 | 0,58 | 0,69 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,44 | 0,93 | 1,01 | 1,16 | 0,94 | 1,14 |
| Ausschüttungen | (0,39) | – | (0,56) | – | (0,33) | – |
| Schlussnettoinventarwert | 4,02 | 8,92 | 7,97 | 9,52 | 7,55 | 9,26 |
| Gesamtertrag | 11,71 % | 11,64 % | 13,97 % | 13,88 % | 13,94 % | 14,04 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 3,01 % | 2,99 % | 0,94 % | 0,95 % | 0,94 % | 0,80 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,06 % | 3,07 % | 5,08 % | 5,08 % | 5,04 % | 5,22 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 5,14 | 9,36 | 9,23 | 9,60 | 8,34 | 9,30 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,12 | 0,23 | 0,38 | 0,41 | 0,34 | 0,41 |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (0,86) | (1,60) | (1,56) | (1,65) | (1,41) | (1,59) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (0,74) | (1,37) | (1,18) | (1,24) | (1,07) | (1,18) |
| Ausschüttungen | (0,43) | – | (0,53) | – | (0,33) | – |
| Schlussnettoinventarwert | 3,97 | 7,99 | 7,52 | 8,36 | 6,94 | 8,12 |
| Gesamtertrag | (14,56 %) | (14,64 %) | (12,87 %) | (12,92 %) | (12,85 %) | (12,69 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 2,97 % | 2,96 % | 0,91 % | 0,91 % | 0,93 % | 0,76 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,73 % | 2,75 % | 4,80 % | 4,82 % | 4,72 % | 4,96 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD I5 US\$ | Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) US\$ | Thesaurierende Klasse USD T US\$ | Thesaurierende Klasse USD X US\$ | Thesaurierende Klasse USD Y US\$ | Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich) ZAR |
|---|---|--|--|--|--|---|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,08 | 4,35 | 8,61 | 8,27 | 8,03 | 36,58 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (2,11) | 0,18 | 0,37 | 0,49 | 0,47 | 1,10 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 3,23 | 0,35 | 0,73 | 0,70 | 0,68 | 3,71 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1,12 | 0,53 | 1,10 | 1,19 | 1,15 | 4,81 |
| Ausschüttungen | – | (0,43) | – | – | – | (4,87) |
| Schlussnettoinventarwert | 10,20 | 4,45 | 9,71 | 9,46 | 9,18 | 36,52 |
| Gesamtertrag | 12,33 % | 12,86 % | 12,78 % | 14,39 % | 14,32 % | 14,22 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,56 % | 2,00 % | 2,00 % | 0,49 % | 0,56 % | 3,00 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (22,17 %) | 4,03 % | 4,02 % | 5,53 % | 5,47 % | 3,03 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,74 | 5,58 | 9,99 | 9,45 | 9,18 | 47,97 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (1.994,20) | 0,17 | 0,33 | 0,44 | 0,42 | 1,16 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 1.992,54 | (0,93) | (1,71) | (1,62) | (1,57) | (6,89) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,66) | (0,76) | (1,38) | (1,18) | (1,15) | (5,73) |
| Ausschüttungen | – | (0,47) | – | – | – | (5,66) |
| Schlussnettoinventarwert | 9,08 | 4,35 | 8,61 | 8,27 | 8,03 | 36,58 |
| Gesamtertrag | (15,46 %) | (13,76 %) | (13,81 %) | (12,49 %) | (12,53 %) | (12,08 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | – | 1,96 % | 1,95 % | 0,48 % | 0,52 % | 3,08 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (21401,14 %) | 3,78 % | 3,79 % | 5,26 % | 5,23 % | 2,80 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse ZAR B ZAR | Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich) ZAR | Thesaurierende Klasse ZAR C2** ZAR | Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) ZAR | Thesaurierende Klasse ZAR E ZAR | Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) ZAR |
|---|---------------------------------------|--|--|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 107,97 | 36,57 | 107,65 | 36,58 | 107,98 | 39,47 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 3,61 | 1,08 | 3,31 | 1,09 | 3,55 | 1,57 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 11,70 | 3,75 | 10,41 | 3,72 | 11,70 | 4,04 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 15,31 | 4,83 | 13,72 | 4,81 | 15,25 | 5,61 |
| Ausschüttungen | – | (4,87) | – | (4,87) | – | (5,28) |
| Schlussnettoinventarwert | 123,28 | 36,53 | 121,37 | 36,52 | 123,23 | 39,80 |
| Gesamtertrag | 14,18 % | 14,29 % | 12,75 %*** | 14,22 % | 14,12 % | 15,36 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 2,95 % | 3,05 % | 2,95 % | 2,99 % | 2,86 % | 1,98 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,13 % | 2,92 % | 2,97 % | 3,01 % | 3,06 % | 4,00 % |

**Wiederaufnahme der Geschäfte am Dienstag, 6. Januar 2023.

*** Die Gesamterträge für den Zeitraum von 1. Januar 2023 bis 3. Januar 2023 betrug 0,30 %.

31. Dezember 2022

| | | | | | | |
|---|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| Eröffnungsnettoinventarwert | 122,85 | 47,95 | 122,83 | 47,96 | 122,85 | 51,24 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 3,18 | 1,17 | 3,37 | 1,17 | 3,20 | 1,66 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (18,06) | (6,89) | (18,23) | (6,89) | (18,07) | (7,36) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (14,88) | (5,72) | (14,86) | (5,72) | (14,87) | (5,70) |
| Ausschüttungen | – | (5,66) | – | (5,66) | – | (6,07) |
| Schlussnettoinventarwert | 107,97 | 36,57 | 107,97 | 36,58 | 107,98 | 39,47 |
| Gesamtertrag | (12,11 %) | (12,07 %) | (12,10 %) | (12,07 %) | (12,10 %) | (11,19 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 3,08 % | 3,09 % | 3,09 % | 3,09 % | 3,09 % | 2,03 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,81 % | 2,76 % | 2,66 % | 2,77 % | 2,74 % | 3,91 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse ZAR T ZAR |
|--|---------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 116,49 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 4,98 |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 12,88 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 17,86 |
| Schlussnettoinventarwert | 134,35 |
| Gesamtertrag | 15,33 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,98 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,99 % |
| 31. Dezember 2022 | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 131,23 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 4,58 |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (19,32) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (14,74) |
| Schlussnettoinventarwert | 116,49 |
| Gesamtertrag | (11,23 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 2,03 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,93 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend

| | Ausschüttende Klasse AUD I3 AUD | Thesaurierende Klasse EUR A € | Thesaurierende Klasse EUR I € | Ausschüttende Klasse EUR I € | Thesaurierende Klasse EUR I2 € | Ausschüttende Klasse EUR I2 € |
|---|---------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 7,49 | 9,66 | 9,92 | 6,93 | 10,19 | 6,74 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,37 | 0,39 | 0,47 | 0,32 | 0,50 | 0,32 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,46 | 0,41 | 0,42 | 0,28 | 0,43 | 0,28 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,83 | 0,80 | 0,89 | 0,60 | 0,93 | 0,60 |
| Ausschüttungen | (0,36) | – | – | (0,31) | – | (0,31) |
| Schlussnettoinventarwert | 7,96 | 10,46 | 10,81 | 7,22 | 11,12 | 7,03 |
| Gesamtertrag | 11,37 % | 8,28 % | 8,97 % | 8,97 % | 9,13 % | 9,24 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen
Nettovermögen**

| | | | | | | |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,58 % | 1,48 % | 0,79 % | 0,79 % | 0,66 % | 0,66 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,82 % | 3,95 % | 4,63 % | 4,64 % | 4,77 % | 4,78 % |

31. Dezember 2022

| | | | | | | |
|---|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| Eröffnungsnettoinventarwert | 8,87 | 11,09 | 11,31 | 8,29 | 11,60 | 8,07 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,41 | 0,43 | 0,51 | 0,36 | 0,53 | 0,36 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,39) | (1,86) | (1,90) | (1,36) | (1,94) | (1,33) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (0,98) | (1,43) | (1,39) | (1,00) | (1,41) | (0,97) |
| Ausschüttungen | (0,40) | – | – | (0,36) | – | (0,36) |
| Schlussnettoinventarwert | 7,49 | 9,66 | 9,92 | 6,93 | 10,19 | 6,74 |
| Gesamtertrag | (11,15 %) | (12,89 %) | (12,29 %) | (12,26 %) | (12,16 %) | (12,21 %) |

**Verhältnis zum durchschnittlichen
Nettovermögen**

| | | | | | | |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,68 % | 1,55 % | 0,87 % | 0,87 % | 0,73 % | 0,73 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,38 % | 4,28 % | 4,91 % | 4,92 % | 4,98 % | 4,99 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

| | Ausschüttende Klasse EUR I3 | Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) JPY I | Thesaurierende Klasse EUR I5 | Thesaurierende Klasse EUR M | Ausschüttende Klasse EUR M | Thesaurierende Klasse EUR Z |
|---|--------------------------------|--|---------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|
| | € | € | € | € | € | € |
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 7,48 | 9,81 | 10,76 | 9,32 | 6,05 | 10,65 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,36 | 0,50 | 0,55 | 0,30 | 0,18 | 0,58 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,32 | 0,36 | 0,46 | 0,40 | 0,23 | 0,47 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,68 | 0,86 | 1,01 | 0,70 | 0,41 | 1,05 |
| Ausschüttungen | (0,33) | – | – | – | (0,47) | – |
| Schlussnettoinventarwert | 7,83 | 10,67 | 11,77 | 10,02 | 5,99 | 11,70 |
| Gesamtertrag | 9,37 % | 8,77 % | 9,39 % | 7,51 % | 7,29 % | 9,86 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,59 % | 0,52 % | 0,45 % | 2,26 % | 2,29 % | 0,11 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,75 % | 4,87 % | 4,98 % | 3,16 % | 3,00 % | 5,27 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 8,91 | 10,69 | 12,22 | 10,79 | 7,54 | 12,06 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,25 | 0,53 | 0,59 | 0,34 | 0,22 | 0,62 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,32) | (1,41) | (2,05) | (1,81) | (1,22) | (2,03) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,07) | (0,88) | (1,46) | (1,47) | (1,00) | (1,41) |
| Ausschüttungen | (0,36) | – | – | – | (0,49) | – |
| Schlussnettoinventarwert | 7,48 | 9,81 | 10,76 | 9,32 | 6,05 | 10,65 |
| Gesamtertrag | (12,11 %) | (8,23 %) | (11,95 %) | (13,62 %) | (13,51 %) | (11,69 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,65 % | 0,59 % | 0,52 % | 2,34 % | 2,34 % | 0,18 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,19 % | 5,24 % | 5,25 % | 3,43 % | 3,37 % | 5,63 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse GBP I | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | Ausschüttende Klasse GBP I | Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | Thesaurierende Klasse GBP P | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) |
|--|--------------------------------|---|-------------------------------|--|--------------------------------|---|
| | £ | £ | £ | £ | £ | £ |
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,65 | 9,93 | 7,75 | 8,39 | 9,33 | 9,85 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,51 | (2,57) | 0,36 | 0,38 | 0,45 | 0,46 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,41 | 3,17 | 0,28 | 0,09 | 0,36 | 0,13 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,92 | 0,60 | 0,64 | 0,47 | 0,81 | 0,59 |
| Ausschüttungen | – | – | (0,34) | (0,37) | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 11,57 | 10,53 | 8,05 | 8,49 | 10,14 | 10,44 |
| Gesamtertrag | 8,64 % | 6,04 % | 8,63 % | 5,83 % | 8,68 % | 5,99 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,80 % | 0,73 % | 0,79 % | 0,79 % | 0,76 % | 0,76 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,63 % | (25,53 %) | 4,63 % | 4,63 % | 4,67 % | 4,65 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 11,71 | 10,26 | 8,95 | 9,09 | 10,26 | 10,18 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,55 | 0,48 | 0,41 | 0,44 | 0,48 | 0,51 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,61) | (0,81) | (1,22) | (0,73) | (1,41) | (0,84) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,06) | (0,33) | (0,81) | (0,29) | (0,93) | (0,33) |
| Ausschüttungen | – | – | (0,39) | (0,41) | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 10,65 | 9,93 | 7,75 | 8,39 | 9,33 | 9,85 |
| Gesamtertrag | (9,05 %) | (3,22 %) | (9,08 %) | (3,16 %) | (9,06 %) | (3,24 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,90 % | 0,91 % | 0,90 % | 0,90 % | 0,88 % | 0,87 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,10 % | 4,60 % | 5,10 % | 5,14 % | 5,04 % | 5,13 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse GBP Z £ | Thesaurierende Klasse NOK U NOK | Thesaurierende Klasse SEK A SEK | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) SGD | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) US\$ | Thesaurierende Klasse USD A US\$ |
|---|-------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|---|--|--|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 11,54 | 99,75 | 103,59 | 12,31 | 6,26 | 10,49 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,63 | 4,48 | 4,17 | 0,49 | 0,26 | 0,44 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,45 | 8,16 | 4,71 | 0,66 | 0,43 | 0,76 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1,08 | 12,64 | 8,88 | 1,15 | 0,69 | 1,20 |
| Ausschüttungen | – | – | – | (0,79) | (0,40) | – |
| Schlussnettoinventarwert | 12,62 | 112,39 | 112,47 | 12,67 | 6,55 | 11,69 |
| Gesamtertrag | 9,36 % | 12,67 % | 8,57 % | 9,75 % | 11,56 % | 11,44 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,11 % | 1,12 % | 1,43 % | 1,48 % | 1,51 % | 1,51 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,30 % | 4,17 % | 3,84 % | 3,97 % | 4,04 % | 4,06 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 12,60 | 110,49 | 114,14 | 15,39 | 7,79 | 12,29 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,68 | 4,80 | 4,68 | 0,55 | 0,28 | 0,46 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,74) | (15,54) | (15,23) | (2,83) | (1,41) | (2,26) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,06) | (10,74) | (10,55) | (2,28) | (1,13) | (1,80) |
| Ausschüttungen | – | – | – | (0,80) | (0,40) | – |
| Schlussnettoinventarwert | 11,54 | 99,75 | 103,59 | 12,31 | 6,26 | 10,49 |
| Gesamtertrag | (8,41 %) | (9,72 %) | (9,24 %) | (15,04 %) | (14,64 %) | (14,65 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,18 % | 1,25 % | 1,62 % | 1,54 % | 1,58 % | 1,58 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,85 % | 4,74 % | 4,43 % | 4,20 % | 4,32 % | 4,31 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD C1 US\$ | Thesaurierende Klasse USD I US\$ | Ausschüttende Klasse USD I US\$ | Ausschüttende Klasse USD I2 US\$ | Thesaurierende Klasse USD I5* US\$ | Thesaurierende Klasse USD M US\$ |
|---|---|--|---------------------------------------|--|--|--|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 8,23 | 9,85 | 7,69 | 7,05 | 10,00 | 8,29 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,26 | 0,49 | 0,37 | 0,35 | 0,22 | 0,28 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,59 | 0,72 | 0,54 | 0,50 | 0,18 | 0,59 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,85 | 1,21 | 0,91 | 0,85 | 0,40 | 0,87 |
| Ausschüttungen | – | – | (0,35) | (0,33) | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 9,08 | 11,06 | 8,25 | 7,57 | 10,40 | 9,16 |
| Gesamtertrag | 10,33 % | 12,28 % | 12,23 % | 12,49 % | 4,00 % | 10,49 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 2,51 % | 0,81 % | 0,81 % | 0,67 % | 0,46 % | 2,31 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,05 % | 4,75 % | 4,74 % | 4,88 % | 5,05 % | 3,23 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,74 | 11,47 | 9,38 | 8,61 | – | 9,79 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,28 | 0,49 | 0,40 | 0,38 | – | 0,30 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,79) | (2,11) | (1,70) | (1,57) | – | (1,80) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,51) | (1,62) | (1,30) | (1,19) | – | (1,50) |
| Ausschüttungen | – | – | (0,39) | (0,37) | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 8,23 | 9,85 | 7,69 | 7,05 | – | 8,29 |
| Gesamtertrag | (15,50 %) | (14,12 %) | (13,98 %) | (13,96 %) | – | (15,32 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 2,58 % | 0,88 % | 0,88 % | 0,74 % | – | 2,38 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,32 % | 4,78 % | 4,75 % | 5,13 % | – | 3,48 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

| | Ausschüttende Klasse USD M US\$ | Thesaurierende Klasse USD Z US\$ |
|--|---------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 5,94 | 11,70 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,19 | 0,67 |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,40 | 0,86 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,59 | 1,53 |
| Ausschüttungen | (0,47) | – |
| Schlussnettoinventarwert | 6,06 | 13,23 |
| Gesamtertrag | 10,60 % | 13,08 % |

Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen

| | | |
|--------------------------------|--------|--------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 2,31 % | 0,11 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,23 % | 5,43 % |

31. Dezember 2022

| | | |
|--|-----------|-----------|
| Eröffnungsnettoinventarwert | 7,56 | 13,52 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,22 | 0,68 |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,37) | (2,50) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,15) | (1,82) |
| Ausschüttungen | (0,47) | – |
| Schlussnettoinventarwert | 5,94 | 11,70 |
| Gesamtertrag | (15,37 %) | (13,46 %) |

Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen

| | | |
|--------------------------------|--------|--------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 2,38 % | 0,18 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,54 % | 5,72 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

| | Thesaurierende Klasse AUD I2 AUD | Thesaurierende Klasse NOK I NOK | Thesaurierende Klasse NOK I3* NOK | Thesaurierende Klasse USD I US\$ | Thesaurierende Klasse USD I2 US\$ | Thesaurierende Klasse USD Z US\$ |
|---|--|---------------------------------------|---|--|---|--|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 8,67 | 103,11 | 100,00 | 10,34 | 8,61 | 10,33 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,33 | 3,82 | 1,25 | 0,38 | 0,34 | 0,46 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,29 | 4,78 | 1,88 | 0,48 | 0,39 | 0,47 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,62 | 8,60 | 3,13 | 0,86 | 0,73 | 0,93 |
| Schlussnettoinventarwert | 9,29 | 111,71 | 103,13 | 11,20 | 9,34 | 11,26 |
| Gesamtertrag | 7,15 % | 8,34 % | 3,13 % | 8,32 % | 8,48 % | 9,00 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,68 % | 0,78 % | 0,66 % | 0,82 % | 0,70 % | 0,22 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,70 % | 3,53 % | 3,86 % | 3,55 % | 3,80 % | 4,30 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,93 | 116,42 | – | 12,07 | 10,04 | 11,99 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,29 | 3,35 | – | 0,33 | 0,29 | 0,39 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,55) | (16,66) | – | (2,06) | (1,72) | (2,05) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,26) | (13,31) | – | (1,73) | (1,43) | (1,66) |
| Schlussnettoinventarwert | 8,67 | 103,11 | – | 10,34 | 8,61 | 10,33 |
| Gesamtertrag | (12,69 %) | (11,43 %) | – | (14,33 %) | (14,24 %) | (13,84 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,74 % | 0,89 % | – | 0,81 % | 0,73 % | 0,27 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,32 % | 3,20 % | – | 3,17 % | 3,26 % | 3,66 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Equity

| | Thesaurierende Klasse AUD B | Thesaurierende Klasse AUD C2 | Thesaurierende Klasse AUD E | Thesaurierende Klasse AUD T | Ausschüttende Klasse CAD I (nicht währungsgesichert) | Ausschüttende Klasse CAD I2 |
|---|--------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--|--------------------------------|
| | AUD | AUD | AUD | AUD | CAD | CAD |
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,13 | 9,13 | 9,12 | 9,69 | 7,87 | 7,64 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,10) | (0,09) | (0,12) | (0,01) | 0,07 | 0,08 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,39 | 0,39 | 0,41 | 0,43 | 0,31 | 0,44 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,29 | 0,30 | 0,29 | 0,42 | 0,38 | 0,52 |
| Ausschüttungen | – | – | – | – | (0,18) | (0,19) |
| Schlussnettoinventarwert | 9,42 | 9,43 | 9,41 | 10,11 | 8,07 | 7,97 |
| Gesamtertrag | 3,18 % | 3,29 % | 3,18 % | 4,33 % | 4,89 % | 6,93 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 3,24 % | 3,24 % | 3,27 % | 2,27 % | 1,29 % | 1,10 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (1,04 %) | (1,01 %) | (1,26 %) | (0,08 %) | 0,91 % | 1,10 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 12,57 | 12,57 | 12,56 | 13,22 | 9,67 | 10,16 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,15) | (0,16) | (0,12) | (0,02) | 0,07 | 0,08 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (3,29) | (3,28) | (3,32) | (3,51) | (1,84) | (2,60) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (3,44) | (3,44) | (3,44) | (3,53) | (1,77) | (2,52) |
| Ausschüttungen | – | – | – | – | (0,03) | 0,00 |
| Schlussnettoinventarwert | 9,13 | 9,13 | 9,12 | 9,69 | 7,87 | 7,64 |
| Gesamtertrag | (27,37 %) | (27,37 %) | (27,39 %) | (26,70 %) | (18,34 %) | (24,79 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 3,35 % | 3,35 % | 3,35 % | 2,33 % | 1,33 % | 1,12 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (1,42 %) | (1,52 %) | (1,22 %) | (0,21 %) | 0,82 % | 1,01 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse EUR I € | Thesaurierende Klasse EUR M € | Thesaurierende Klasse EUR Z € | Thesaurierende Klasse GBP I £ | Thesaurierende Klasse GBP Z £ | Thesaurierende Klasse USD A US\$ |
|---|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 8,60 | 9,87 | 7,33 | 9,77 | 11,72 | 9,44 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,07 | (0,10) | 0,14 | 0,09 | 0,23 | (0,01) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,37 | 0,40 | 0,31 | 0,57 | 0,70 | 0,65 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,44 | 0,30 | 0,45 | 0,66 | 0,93 | 0,64 |
| Schlussnettoinventarwert | 9,04 | 10,17 | 7,78 | 10,43 | 12,65 | 10,08 |
| Gesamtertrag | 5,12 % | 3,04 % | 6,14 % | 6,76 % | 7,94 % | 6,78 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,29 % | 3,26 % | 0,31 % | 1,29 % | 0,31 % | 2,32 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,83 % | (1,05 %) | 1,89 % | 0,92 % | 1,89 % | (0,06 %) |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 11,68 | 13,67 | 9,85 | 13,06 | 15,52 | 12,53 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,05 | (0,14) | 0,14 | 0,08 | 0,18 | (0,02) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (3,13) | (3,66) | (2,66) | (3,37) | (3,98) | (3,07) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (3,08) | (3,80) | (2,52) | (3,29) | (3,80) | (3,09) |
| Schlussnettoinventarwert | 8,60 | 9,87 | 7,33 | 9,77 | 11,72 | 9,44 |
| Gesamtertrag | (26,37 %) | (27,80 %) | (25,58 %) | (25,19 %) | (24,48 %) | (24,66 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,26 % | 3,23 % | 0,27 % | 1,31 % | 0,28 % | 2,28 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,47 % | (1,26 %) | 1,72 % | 0,76 % | 1,30 % | (0,20 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD B US\$ | Thesaurierende Klasse USD C2 US\$ | Thesaurierende Klasse USD E US\$ | Thesaurierende Klasse USD I US\$ | Thesaurierende Klasse USD M US\$ | Thesaurierende Klasse USD T US\$ |
|---|--|---|--|--|--|--|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,96 | 9,95 | 9,94 | 10,66 | 10,60 | 10,57 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,11) | (0,23) | (0,08) | 0,08 | (0,11) | (0,03) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,67 | 0,78 | 0,64 | 0,74 | 0,71 | 0,75 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,56 | 0,55 | 0,56 | 0,82 | 0,60 | 0,72 |
| Schlussnettoinventarwert | 10,52 | 10,50 | 10,50 | 11,48 | 11,20 | 11,29 |
| Gesamtertrag | 5,62 % | 5,53 % | 5,63 % | 7,69 % | 5,66 % | 6,81 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 3,33 % | 3,53 % | 3,31 % | 1,33 % | 3,34 % | 2,33 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (1,10 %) | (2,25 %) | (0,77 %) | 0,75 % | (1,05 %) | (0,29 %) |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 13,34 | 13,33 | 13,33 | 14,00 | 14,21 | 14,04 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,15) | (0,15) | (0,12) | 0,09 | (0,15) | 0,01 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (3,23) | (3,23) | (3,27) | (3,43) | (3,46) | (3,48) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (3,38) | (3,38) | (3,39) | (3,34) | (3,61) | (3,47) |
| Schlussnettoinventarwert | 9,96 | 9,95 | 9,94 | 10,66 | 10,60 | 10,57 |
| Gesamtertrag | (25,34 %) | (25,36 %) | (25,43 %) | (23,86 %) | (25,40 %) | (24,72 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 3,28 % | 3,28 % | 3,28 % | 1,28 % | 3,28 % | 2,29 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (1,35 %) | (1,36 %) | (1,15 %) | 0,79 % | (1,30 %) | 0,12 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD Z US\$ | Thesaurierende Klasse ZAR B ZAR | Thesaurierende Klasse ZAR C2 ZAR | Thesaurierende Klasse ZAR E ZAR | Thesaurierende Klasse ZAR T ZAR |
|---|--|---------------------------------------|--|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,94 | 121,51 | 121,50 | 121,51 | 129,33 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,22 | (1,19) | (2,96) | (1,34) | (0,14) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,75 | 10,71 | 12,46 | 10,85 | 11,67 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,97 | 9,52 | 9,50 | 9,51 | 11,53 |
| Schlussnettoinventarwert | 11,91 | 131,03 | 131,00 | 131,02 | 140,86 |
| Gesamtertrag | 8,87 % | 7,83 % | 7,82 % | 7,83 % | 8,92 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,32 % | 3,31 % | 3,63 % | 3,31 % | 2,30 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 1,93 % | (0,95 %) | (2,32 %) | (1,06 %) | (0,10 %) |
| 31. Dezember 2022 | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 14,23 | 159,43 | 159,42 | 159,43 | 168,00 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,19 | (2,17) | (2,29) | (1,88) | (0,27) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (3,48) | (35,75) | (35,63) | (36,04) | (38,40) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (3,29) | (37,92) | (37,92) | (37,92) | (38,67) |
| Schlussnettoinventarwert | 10,94 | 121,51 | 121,50 | 121,51 | 129,33 |
| Gesamtertrag | (23,12 %) | (23,78 %) | (23,79 %) | (23,78 %) | (23,02 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,28 % | 3,41 % | 3,41 % | 3,41 % | 2,37 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 1,57 % | (1,58 %) | (1,67 %) | (1,41 %) | (0,20 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Euro Bond

| | Thesaurierende Klasse EUR I € | Ausschüttende Klasse EUR I € |
|---|-------------------------------------|------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,96 | 9,41 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,27 | 0,24 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,72 | 0,68 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,99 | 0,92 |
| Ausschüttungen | – | (0,20) |
| Schlussnettoinventarwert | 10,95 | 10,13 |
| Gesamtertrag | 9,94 % | 9,96 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen
Nettovermögen**

| | | |
|--------------------------------|--------|--------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,57 % | 0,56 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,60 % | 2,54 % |

31. Dezember 2022

| | | |
|---|-----------|-----------|
| Eröffnungsnettoinventarwert | 11,80 | 11,42 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,29 | 0,25 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (2,13) | (2,03) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,84) | (1,78) |
| Ausschüttungen | – | (0,23) |
| Schlussnettoinventarwert | 9,96 | 9,41 |
| Gesamtertrag | (15,59 %) | (15,68 %) |

**Verhältnis zum durchschnittlichen
Nettovermögen**

| | | |
|--------------------------------|--------|--------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,57 % | 0,57 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,75 % | 2,48 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Euro Bond Absolute Return

| | Thesaurierende Klasse EUR I € | Ausschüttende Klasse EUR I € | Thesaurierende Klasse EUR I5 € | Thesaurierende Klasse USD Z US\$ |
|---|-------------------------------------|------------------------------------|--------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,52 | 10,04 | 10,55 | 10,86 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,26 | 0,24 | 0,27 | 0,33 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,60 | 0,56 | 0,61 | 0,85 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,86 | 0,80 | 0,88 | 1,18 |
| Ausschüttungen | – | (0,17) | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 11,38 | 10,67 | 11,43 | 12,04 |
| Gesamtertrag | 8,17 % | 8,10 % | 8,34 % | 10,87 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen
Nettovermögen**

| | | | | |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,67 % | 0,66 % | 0,45 % | 0,23 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,39 % | 2,38 % | 2,54 % | 2,89 % |

31. Dezember 2022

| | | | | |
|---|----------|----------|----------|----------|
| Eröffnungsnettoinventarwert | 11,04 | 10,73 | 11,04 | 11,11 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,21 | 0,21 | 0,24 | 0,28 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (0,73) | (0,70) | (0,73) | (0,53) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (0,52) | (0,49) | (0,49) | (0,25) |
| Ausschüttungen | – | (0,20) | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 10,52 | 10,04 | 10,55 | 10,86 |
| Gesamtertrag | (4,71 %) | (4,58 %) | (4,44 %) | (2,25 %) |

**Verhältnis zum durchschnittlichen
Nettovermögen**

| | | | | |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,68 % | 0,69 % | 0,46 % | 0,24 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 1,97 % | 2,08 % | 2,26 % | 2,58 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

European High Yield Bond

| | Thesaurierende Klasse CHF I* CHF | Thesaurierende Klasse EUR I € | Thesaurierende Klasse EUR I2* € | Thesaurierende Klasse EUR I5* € | Thesaurierende Klasse EUR M € | Thesaurierende Klasse EUR X € |
|---|--|-------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,00 | 12,34 | 10,00 | 10,00 | 11,31 | 10,82 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,34 | 0,58 | 0,07 | 0,05 | 0,37 | 0,56 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,41 | 1,09 | 0,47 | 0,39 | 1,00 | 0,95 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,75 | 1,67 | 0,54 | 0,44 | 1,37 | 1,51 |
| Schlussnettoinventarwert | 10,75 | 14,01 | 10,54 | 10,44 | 12,68 | 12,33 |
| Gesamtertrag | 7,50 % | 13,53 % | 5,40 % | 4,40 % | 12,11 % | 13,96 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,79 % | 0,82 % | 0,72 % | 0,48 % | 2,01 % | 0,42 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,15 % | 4,39 % | 4,91 % | 4,82 % | 3,08 % | 4,81 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | – | 13,64 | – | – | 12,65 | 11,91 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | – | 0,46 | – | – | 0,29 | 0,45 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | – | (1,76) | – | – | (1,63) | (1,54) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | – | (1,30) | – | – | (1,34) | (1,09) |
| Schlussnettoinventarwert | – | 12,34 | – | – | 11,31 | 10,82 |
| Gesamtertrag | – | (9,53 %) | – | – | (10,59 %) | (9,15 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | – | 0,81 % | – | – | 2,01 % | 0,41 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | – | 3,68 % | – | – | 2,49 % | 4,07 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

European High Yield Bond (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse EUR Y* | Ausschüttende Klasse EUR Y | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | Thesaurierende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD X | Thesaurierende Klasse USD Z |
|---|---------------------------------|-------------------------------|--|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| | € | € | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,00 | 10,00 | 8,63 | 14,23 | 11,95 | 11,25 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,52 | 0,25 | 0,33 | 0,66 | 0,63 | 0,60 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,78 | 0,61 | 0,93 | 1,60 | 1,32 | 1,26 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1,30 | 0,86 | 1,26 | 2,26 | 1,95 | 1,86 |
| Ausschüttungen | – | (0,12) | (0,64) | – | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 11,30 | 10,74 | 9,25 | 16,49 | 13,90 | 13,11 |
| Gesamtertrag | 13,00 % | 8,72 % | 15,17 % | 15,88 % | 16,32 % | 16,53 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,31 % | 0,31 % | 1,44 % | 0,83 % | 0,43 % | 0,22 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,92 % | 4,79 % | 3,74 % | 4,36 % | 4,94 % | 4,98 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | – | – | 9,97 | 15,39 | 12,87 | 12,09 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | – | – | 0,27 | 0,53 | 0,48 | 0,49 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | – | – | (1,08) | (1,69) | (1,40) | (1,33) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | – | – | (0,81) | (1,16) | (0,92) | (0,84) |
| Ausschüttungen | – | – | (0,53) | – | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | – | – | 8,63 | 14,23 | 11,95 | 11,25 |
| Gesamtertrag | – | – | (8,12 %) | (7,54 %) | (7,15 %) | (6,95 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | – | – | 1,43 % | 0,82 % | 0,42 % | 0,22 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | – | – | 3,04 % | 3,72 % | 4,05 % | 4,33 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

European Sustainable Equity

| | Ausschüttende Klasse EUR A € | Thesaurierende Klasse EUR I € | Ausschüttende Klasse EUR I € | Ausschüttende Klasse EUR I3 € | Thesaurierende Klasse EUR I5 € | Thesaurierende Klasse EUR M € |
|--|------------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|-------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 7,93 | 9,11 | 9,09 | 7,79 | 7,96 | 8,83 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,04) | 0,05 | 0,05 | 0,06 | 0,07 | (0,12) |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 1,45 | 1,68 | 1,67 | 1,42 | 1,46 | 1,62 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1,41 | 1,73 | 1,72 | 1,48 | 1,53 | 1,50 |
| Ausschüttungen | – | – | (0,06) | (0,06) | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 9,34 | 10,84 | 10,75 | 9,21 | 9,49 | 10,33 |
| Gesamtertrag | 17,78 % | 18,99 % | 19,00 % | 19,19 % | 19,22 % | 16,99 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,64 % | 0,75 % | 0,72 % | 0,57 % | 0,45 % | 2,45 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,41 %) | 0,52 % | 0,55 % | 0,65 % | 0,81 % | (1,24 %) |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,00 | 12,14 | 12,15 | 10,37 | 10,57 | 11,97 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,02) | 0,05 | 0,07 | 0,06 | 0,08 | (0,10) |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (2,05) | (3,08) | (3,10) | (2,64) | (2,69) | (3,04) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (2,07) | (3,03) | (3,03) | (2,58) | (2,61) | (3,14) |
| Ausschüttungen | – | – | (0,03) | 0,00 | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 7,93 | 9,11 | 9,09 | 7,79 | 7,96 | 8,83 |
| Gesamtertrag | (20,70 %) | (24,96 %) | (25,02 %) | (24,86 %) | (24,69 %) | (26,23 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,66 % | 0,75 % | 0,75 % | 0,59 % | 0,46 % | 2,46 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,24 %) | 0,53 % | 0,68 % | 0,72 % | 0,89 % | (1,10 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

European Sustainable Equity (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse EUR Z | Thesaurierende Klasse USD A (nicht währungsgesichert) | Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) | Thesaurierende Klasse USD M (nicht währungsgesichert) |
|--|--------------------------------|---|---|--|
| | € | US\$ | US\$ | US\$ |
| 31. Dezember 2023 | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,12 | 8,03 | 8,15 | 7,91 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,12 | (0,03) | (0,04) | (0,10) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 1,68 | 1,80 | 1,93 | 1,77 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1,80 | 1,77 | 1,89 | 1,67 |
| Schlussnettoinventarwert | 10,92 | 9,80 | 10,04 | 9,58 |
| Gesamtertrag | 19,74 % | 22,04 % | 23,19 % | 21,11 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,15 % | 1,66 % | 0,75 % | 2,48 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 1,17 % | (0,37 %) | (0,43 %) | (1,18 %) |
| 31. Dezember 2022 | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 12,09 | 11,50 | 11,58 | 11,43 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,00 | (0,02) | 0,05 | (0,09) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (2,97) | (3,45) | (3,48) | (3,43) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (2,97) | (3,47) | (3,43) | (3,52) |
| Schlussnettoinventarwert | 9,12 | 8,03 | 8,15 | 7,91 |
| Gesamtertrag | (24,57 %) | (30,17 %) | (29,62 %) | (30,80 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,29 % | 1,64 % | 0,77 % | 2,46 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,03 %) | (0,27 %) | 0,60 % | (1,08 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Event Driven²

| | Thesaurierende Klasse EUR I* € | Thesaurierende Klasse GBP I5 £ | Ausschüttende Klasse GBP I5 £ | Thesaurierende Klasse GBP P £ | Thesaurierende Klasse USD I US\$ | Thesaurierende Klasse USD I5 US\$ |
|---|--------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|--|---|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,00 | 10,11 | 10,11 | 10,10 | 10,12 | 10,13 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,05) | (0,17) | (0,12) | (0,18) | (0,31) | (0,16) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,36 | 0,60 | 0,56 | 0,58 | 0,74 | 0,64 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,31 | 0,43 | 0,44 | 0,40 | 0,43 | 0,48 |
| Schlussnettoinventarwert | 10,31 | 10,54 | 10,55 | 10,50 | 10,55 | 10,61 |
| Gesamtertrag | 3,10 % | 4,25 % | 4,35 % | 3,96 % | 4,25 % | 4,74 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,23 % | 2,28 % | 1,78 % | 2,35 % | 3,55 % | 2,22 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,55 %) | (1,65 %) | (1,15 %) | (1,73 %) | (3,06 %) | (1,58 %) |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | – | 10,00 | 10,00 | 10,00 | 10,00 | 10,00 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | – | (0,02) | (0,02) | (0,03) | (0,04) | (0,02) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | – | 0,13 | 0,13 | 0,13 | 0,16 | 0,15 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | – | 0,11 | 0,11 | 0,10 | 0,12 | 0,13 |
| Schlussnettoinventarwert | – | 10,11 | 10,11 | 10,10 | 10,12 | 10,13 |
| Gesamtertrag | – | 1,10 % | 1,10 % | 1,00 % | 1,20 % | 1,30 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | – | 1,76 % | 1,72 % | 2,42 % | 2,70 % | 1,94 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | – | (1,13 %) | (1,10 %) | (1,79 %) | (2,07 %) | (1,30 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Bond

| | Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) | Thesaurierende Klasse EUR I Benchmark Währungsgesicherte Klasse* | Thesaurierende Klasse USD C1 | Thesaurierende Klasse USD I Benchmark Währungsgesicherte Klasse | Thesaurierende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD M |
|--|--|--|---------------------------------|---|--------------------------------|--------------------------------|
| | AUD | € | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 7,44 | 10,00 | 8,57 | 10,18 | 9,63 | 9,00 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,19 | 0,11 | 0,18 | 0,35 | 0,32 | 0,25 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,11 | 0,29 | 0,27 | 0,45 | 0,31 | 0,29 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,30 | 0,40 | 0,45 | 0,80 | 0,63 | 0,54 |
| Ausschüttungen | (0,21) | – | – | – | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 7,53 | 10,40 | 9,02 | 10,98 | 10,26 | 9,54 |
| Gesamtertrag | 4,22 % | 4,00 % | 5,25 % | 7,86 % | 6,54 % | 6,00 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,94 % | 0,41 % | 1,61 % | 0,36 % | 0,41 % | 1,01 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,65 % | 3,38 % | 2,07 % | 3,33 % | 3,34 % | 2,73 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,22 | – | 10,29 | 10,00 | 11,42 | 10,76 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,11 | – | 0,06 | 0,07 | 0,20 | 0,09 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,69) | – | (1,78) | 0,11 | (1,99) | (1,85) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,58) | – | (1,72) | 0,18 | (1,79) | (1,76) |
| Ausschüttungen | (0,20) | – | – | – | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 7,44 | – | 8,57 | 10,18 | 9,63 | 9,00 |
| Gesamtertrag | (17,25 %) | – | (16,72 %) | 1,80 % | (15,67 %) | (16,36 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,12 % | – | 1,83 % | 0,62 % | 0,52 % | 1,41 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 1,42 % | – | 0,63 % | 2,48 % | 1,97 % | 0,95 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Bond (Fortsetzung)

| | Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) US\$ | Thesaurierende Klasse USD Z US\$ | Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) ZAR |
|---|--|--|---|
| 31. Dezember 2023 | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 7,67 | 10,10 | 75,50 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,21 | 0,35 | 2,01 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,24 | 0,34 | 4,31 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,45 | 0,69 | 6,32 |
| Ausschüttungen | (0,22) | – | (4,79) |
| Schlussnettoinventarwert | 7,90 | 10,79 | 77,03 |
| Gesamtertrag | 6,03 % | 6,83 % | 8,79 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,97 % | 0,22 % | 0,96 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,72 % | 3,46 % | 2,69 % |
| 31. Dezember 2022 | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,38 | 11,94 | 92,85 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,11 | 0,24 | 1,16 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,61) | (2,08) | (13,12) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,50) | (1,84) | (11,96) |
| Ausschüttungen | (0,21) | – | (5,39) |
| Schlussnettoinventarwert | 7,67 | 10,10 | 75,50 |
| Gesamtertrag | (16,15 %) | (15,41 %) | (13,12 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,10 % | 0,21 % | 1,14 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 1,39 % | 2,26 % | 1,43 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Diversified Income FMP – 2024

| | Thesaurierende Klasse EUR A € | Ausschüttende Klasse EUR A € | Ausschüttende Klasse EUR I € | Ausschüttende Klasse GBP I £ | Ausschüttende Klasse HKD A HKD | Ausschüttende Klasse SGD A SGD |
|---|-------------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,67 | 8,94 | 8,83 | 9,16 | 9,08 | 18,40 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,31 | 0,28 | 0,31 | 0,32 | 0,29 | 0,58 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,01 | 0,00 | 0,01 | 0,16 | 0,11 | 0,16 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,32 | 0,28 | 0,32 | 0,48 | 0,40 | 0,74 |
| Ausschüttungen | – | (0,30) | (0,33) | (0,34) | (0,31) | (0,62) |
| Schlussnettoinventarwert | 9,99 | 8,92 | 8,82 | 9,30 | 9,17 | 18,52 |
| Gesamtertrag | 3,31 % | 3,20 % | 3,72 % | 5,42 % | 4,48 % | 4,11 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,89 % | 0,89 % | 0,50 % | 0,50 % | 0,91 % | 0,90 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,15 % | 3,15 % | 3,55 % | 3,53 % | 3,21 % | 3,18 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,33 | 9,90 | 9,79 | 9,99 | 9,90 | 20,00 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,35 | 0,32 | 0,36 | 0,38 | 0,33 | 0,65 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,01) | (0,94) | (0,94) | (0,82) | (0,81) | (1,56) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (0,66) | (0,62) | (0,58) | (0,44) | (0,48) | (0,91) |
| Ausschüttungen | – | (0,34) | (0,38) | (0,39) | (0,34) | (0,69) |
| Schlussnettoinventarwert | 9,67 | 8,94 | 8,83 | 9,16 | 9,08 | 18,40 |
| Gesamtertrag | (6,39 %) | (6,28 %) | (6,00 %) | (4,41 %) | (4,88 %) | (4,56 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,87 % | 0,87 % | 0,47 % | 0,49 % | 0,88 % | 0,86 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,51 % | 3,51 % | 3,91 % | 4,06 % | 3,56 % | 3,47 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Diversified Income FMP – 2024 (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD A US\$ | Ausschüttende Klasse USD A US\$ | Thesaurierende Klasse USD I US\$ | Ausschüttende Klasse USD I US\$ | Thesaurierende Klasse USD X US\$ | Ausschüttende Klasse USD X US\$ |
|---|--|---------------------------------------|--|---------------------------------------|--|---------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,01 | 9,23 | 10,11 | 9,23 | 10,10 | 9,24 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,33 | 0,30 | 0,38 | 0,34 | 0,37 | 0,33 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,22 | 0,18 | 0,21 | 0,19 | 0,22 | 0,19 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,55 | 0,48 | 0,59 | 0,53 | 0,59 | 0,52 |
| Ausschüttungen | – | (0,31) | – | (0,35) | – | (0,35) |
| Schlussnettoinventarwert | 10,56 | 9,40 | 10,70 | 9,41 | 10,69 | 9,41 |
| Gesamtertrag | 5,49 % | 5,35 % | 5,84 % | 5,89 % | 5,84 % | 5,72 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen
Nettovermögen**

| | | | | | | |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,91 % | 0,91 % | 0,51 % | 0,51 % | 0,56 % | 0,56 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,23 % | 3,23 % | 3,62 % | 3,62 % | 3,57 % | 3,57 % |

31. Dezember 2022

| | | | | | | |
|---|----------|----------|----------|----------|----------|----------|
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,47 | 10,00 | 10,53 | 10,01 | 10,53 | 10,01 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,36 | 0,33 | 0,40 | 0,37 | 0,40 | 0,37 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (0,82) | (0,76) | (0,82) | (0,77) | (0,83) | (0,76) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (0,46) | (0,43) | (0,42) | (0,40) | (0,43) | (0,39) |
| Ausschüttungen | – | (0,34) | – | (0,38) | – | (0,38) |
| Schlussnettoinventarwert | 10,01 | 9,23 | 10,11 | 9,23 | 10,10 | 9,24 |
| Gesamtertrag | (4,39 %) | (4,28 %) | (3,99 %) | (3,99 %) | (4,08 %) | (3,94 %) |

**Verhältnis zum durchschnittlichen
Nettovermögen**

| | | | | | | |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,88 % | 0,88 % | 0,48 % | 0,48 % | 0,53 % | 0,53 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,57 % | 3,57 % | 3,96 % | 3,97 % | 3,92 % | 3,91 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Equity Megatrends

| | Thesaurierende Klasse EUR I* € | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) € | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)* £ | Thesaurierende Klasse SGD A* SGD | Thesaurierende Klasse USD A US\$ | Thesaurierende Klasse USD C1 US\$ |
|---|--------------------------------------|---|---|--|--|---|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,00 | 13,68 | 10,00 | 20,00 | 12,43 | 11,87 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,00 | (0,23) | 0,01 | 0,00 | (0,11) | (0,24) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (0,05) | 2,54 | 0,62 | 0,85 | 2,83 | 2,70 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (0,05) | 2,31 | 0,63 | 0,85 | 2,72 | 2,46 |
| Schlussnettoinventarwert | 9,95 | 15,99 | 10,63 | 20,85 | 15,15 | 14,33 |
| Gesamtertrag | (0,50 %) | 16,89 % | 6,30 % | 4,25 % | 21,88 % | 20,72 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,07 % | 2,70 % | 1,04 % | 2,02 % | 1,96 % | 2,95 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,91 % | (1,56 %) | 0,14 % | 0,12 % | (0,81 %) | (1,83 %) |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | – | 15,15 | – | – | 14,54 | 14,03 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | – | (0,25) | – | – | (0,13) | (0,25) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | – | (1,22) | – | – | (1,98) | (1,91) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | – | (1,47) | – | – | (2,11) | (2,16) |
| Schlussnettoinventarwert | – | 13,68 | – | – | 12,43 | 11,87 |
| Gesamtertrag | – | (9,70 %) | – | – | (14,51 %) | (15,40 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | – | 2,74 % | – | – | 1,98 % | 2,98 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | – | (1,72 %) | – | – | (0,99 %) | (2,00 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Equity Megatrends (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD I US\$ | Thesaurierende Klasse USD M US\$ | Thesaurierende Klasse USD Z US\$ |
|---|--|--|--|
| 31. Dezember 2023 | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 13,01 | 11,90 | 8,77 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,02 | (0,21) | 0,10 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 2,96 | 2,70 | 2,00 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 2,98 | 2,49 | 2,10 |
| Schlussnettoinventarwert | 15,99 | 14,39 | 10,87 |
| Gesamtertrag | 22,91 % | 20,92 % | 23,95 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,11 % | 2,75 % | 0,26 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,14 % | (1,62 %) | 0,96 % |
| 31. Dezember 2022 | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 15,09 | 14,04 | 10,00 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,02) | (0,23) | 0,05 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (2,06) | (1,91) | (1,28) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (2,08) | (2,14) | (1,23) |
| Schlussnettoinventarwert | 13,01 | 11,90 | 8,77 |
| Gesamtertrag | (13,78 %) | (15,24 %) | (12,30 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,14 % | 2,78 % | 0,25 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,13 %) | (1,80 %) | 0,67 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Flexible Credit Income

| | Thesaurierende Klasse CAD I5 CAD | Thesaurierende Klasse EUR I € | Thesaurierende Klasse EUR M € | Thesaurierende Klasse GBP I5 £ | Thesaurierende Klasse USD A US\$ | Thesaurierende Klasse USD I US\$ |
|---|--|-------------------------------------|-------------------------------------|--------------------------------------|--|--|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,34 | 9,69 | 9,25 | 10,49 | 9,74 | 10,54 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,55 | 0,54 | 0,38 | 0,62 | 0,50 | 0,61 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,58 | 0,43 | 0,42 | 0,65 | 0,65 | 0,71 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1,13 | 0,97 | 0,80 | 1,27 | 1,15 | 1,32 |
| Schlussnettoinventarwert | 10,47 | 10,66 | 10,05 | 11,76 | 10,89 | 11,86 |
| Gesamtertrag | 12,10 % | 10,01 % | 8,65 % | 12,11 % | 11,81 % | 12,52 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,41 % | 0,70 % | 2,08 % | 0,41 % | 1,32 % | 0,72 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,68 % | 5,38 % | 4,03 % | 5,67 % | 4,92 % | 5,52 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,39 | 11,01 | 10,67 | 11,70 | 10,88 | 11,70 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,52 | 0,49 | 0,33 | 0,57 | 0,43 | 0,53 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,57) | (1,81) | (1,75) | (1,78) | (1,57) | (1,69) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,05) | (1,32) | (1,42) | (1,21) | (1,14) | (1,16) |
| Schlussnettoinventarwert | 9,34 | 9,69 | 9,25 | 10,49 | 9,74 | 10,54 |
| Gesamtertrag | (10,11 %) | (11,99 %) | (13,31 %) | (10,34 %) | (10,48 %) | (9,91 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,41 % | 0,69 % | 2,07 % | 0,41 % | 1,30 % | 0,70 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,46 % | 4,89 % | 3,48 % | 5,31 % | 4,36 % | 4,97 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Flexible Credit Income (Fortsetzung)

| | Ausschüttende Klasse USD I US\$ | Thesaurierende Klasse USD M US\$ | Thesaurierende Klasse USD Z US\$ |
|--|---------------------------------------|--|--|
| 31. Dezember 2023 | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,53 | 9,56 | 10,70 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,53 | 0,41 | 0,69 |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,61 | 0,63 | 0,72 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1,14 | 1,04 | 1,41 |
| Ausschüttungen | (0,52) | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 10,15 | 10,60 | 12,11 |
| Gesamtertrag | 12,43 % | 10,88 % | 13,18 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,72 % | 2,12 % | 0,12 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,52 % | 4,12 % | 6,11 % |
| 31. Dezember 2022 | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 11,09 | 10,76 | 11,81 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,49 | 0,34 | 0,59 |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,58) | (1,54) | (1,70) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,09) | (1,20) | (1,11) |
| Ausschüttungen | (0,47) | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 9,53 | 9,56 | 10,70 |
| Gesamtertrag | (9,89 %) | (11,15 %) | (9,40 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,70 % | 2,10 % | 0,10 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,93 % | 3,54 % | 5,40 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global High Yield SDG Engagement

| | Ausschüttende Klasse AUD I AUD | Thesaurierende Klasse CHF I4 CHF | Ausschüttende Klasse CHF I4 CHF | Thesaurierende Klasse CHF X CHF | Thesaurierende Klasse EUR I4 € | Ausschüttende Klasse EUR I4 € |
|---|--------------------------------------|--|---------------------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,36 | 9,53 | 9,32 | 9,49 | 9,51 | 9,30 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,48 | 0,50 | 0,47 | 0,43 | 0,53 | 0,50 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,29 | 0,08 | 0,07 | 0,08 | 0,25 | 0,22 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,77 | 0,58 | 0,54 | 0,51 | 0,78 | 0,72 |
| Ausschüttungen | (0,48) | – | (0,50) | – | – | (0,50) |
| Schlussnettoinventarwert | 9,65 | 10,11 | 9,36 | 10,00 | 10,29 | 9,52 |
| Gesamtertrag | 8,54 % | 6,09 % | 6,10 % | 5,37 % | 8,20 % | 8,10 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,70 % | 0,45 % | 0,45 % | 1,14 % | 0,47 % | 0,47 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,12 % | 5,18 % | 5,18 % | 4,47 % | 5,39 % | 5,39 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,00 | 10,00 | 10,00 | 10,00 | 10,00 | 10,00 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,32 | 0,32 | 0,32 | 0,28 | 0,32 | 0,32 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (0,89) | (0,79) | (0,79) | (0,79) | (0,81) | (0,81) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (0,57) | (0,47) | (0,47) | (0,51) | (0,49) | (0,49) |
| Ausschüttungen | (0,07) | – | (0,21) | – | – | (0,21) |
| Schlussnettoinventarwert | 9,36 | 9,53 | 9,32 | 9,49 | 9,51 | 9,30 |
| Gesamtertrag | (5,65 %) | (4,70 %) | (4,70 %) | (5,10 %) | (4,90 %) | (4,87 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,71 % | 0,46 % | 0,46 % | 1,16 % | 0,46 % | 0,46 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,09 % | 5,03 % | 5,05 % | 4,41 % | 5,03 % | 5,05 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse EUR X € | Thesaurierende Klasse EUR Z (PF) € | Thesaurierende Klasse GBP I4 £ | Thesaurierende Klasse GBP X £ | Thesaurierende Klasse USD A US\$ | Thesaurierende Klasse USD I US\$ |
|---|-------------------------------------|--|--------------------------------------|-------------------------------------|--|--|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,46 | 10,68 | 9,63 | 9,59 | 11,29 | 11,86 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,45 | 0,62 | 0,54 | 0,46 | 0,54 | 0,66 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,25 | 0,28 | 0,42 | 0,41 | 0,55 | 0,56 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,70 | 0,90 | 0,96 | 0,87 | 1,09 | 1,22 |
| Schlussnettoinventarwert | 10,16 | 11,58 | 10,59 | 10,46 | 12,38 | 13,08 |
| Gesamtertrag | 7,40 % | 8,43 % | 9,97 % | 9,07 % | 9,65 % | 10,29 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,19 % | 0,21 % | 0,47 % | 1,18 % | 1,31 % | 0,71 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,66 % | 5,64 % | 5,40 % | 4,65 % | 4,61 % | 5,35 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,00 | 12,25 | 10,00 | 10,00 | 12,78 | 13,35 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,28 | 0,61 | 0,33 | 0,29 | 0,51 | 0,61 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (0,82) | (2,18) | (0,70) | (0,70) | (2,00) | (2,10) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (0,54) | (1,57) | (0,37) | (0,41) | (1,49) | (1,49) |
| Schlussnettoinventarwert | 9,46 | 10,68 | 9,63 | 9,59 | 11,29 | 11,86 |
| Gesamtertrag | (5,40 %) | (12,82 %) | (3,70 %) | (4,10 %) | (11,66 %) | (11,16 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,16 % | 0,24 % | 0,47 % | 1,20 % | 1,34 % | 0,74 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,41 % | 5,46 % | 5,19 % | 4,55 % | 4,42 % | 5,02 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD I4 US\$ | Ausschüttende Klasse USD M US\$ | Thesaurierende Klasse USD X US\$ | Thesaurierende Klasse USD Z US\$ |
|---|---|---------------------------------------|--|--|
| 31. Dezember 2023 | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,70 | 7,72 | 9,53 | 12,32 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,55 | 0,31 | 0,47 | 0,75 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,48 | 0,35 | 0,46 | 0,61 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1,03 | 0,66 | 0,93 | 1,36 |
| Ausschüttungen | – | (0,46) | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 10,73 | 7,92 | 10,46 | 13,68 |
| Gesamtertrag | 10,62 % | 8,93 % | 9,76 % | 11,04 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,48 % | 1,91 % | 1,21 % | 0,11 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,51 % | 4,06 % | 4,76 % | 5,86 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,00 | 9,32 | 10,76 | 13,79 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,34 | 0,31 | 0,46 | 0,71 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (0,64) | (1,43) | (1,69) | (2,18) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (0,30) | (1,12) | (1,23) | (1,47) |
| Ausschüttungen | – | (0,48) | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 9,70 | 7,72 | 9,53 | 12,32 |
| Gesamtertrag | (3,00 %) | (12,19 %) | (11,43 %) | (10,66 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,48 % | 1,94 % | 1,08 % | 0,14 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,33 % | 3,83 % | 4,74 % | 5,66 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Investment Grade Credit

| | Thesaurierende Klasse EUR I* € | Thesaurierende Klasse USD I US\$ | Thesaurierende Klasse USD X US\$ | Thesaurierende Klasse USD Z US\$ |
|---|--------------------------------------|--|--|--|
| 31. Dezember 2023 | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,00 | 8,44 | 8,46 | 8,47 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,17 | 0,32 | 0,34 | 0,35 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,34 | 0,49 | 0,49 | 0,49 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,51 | 0,81 | 0,83 | 0,84 |
| Schlussnettoinventarwert | 10,51 | 9,25 | 9,29 | 9,31 |
| Gesamtertrag | 5,10 % | 9,60 % | 9,81 % | 9,92 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,45 % | 0,47 % | 0,27 % | 0,17 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,94 % | 3,72 % | 3,90 % | 4,01 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | – | 9,88 | 9,88 | 9,89 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | – | 0,26 | 0,26 | 0,27 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | – | (1,70) | (1,68) | (1,69) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | – | (1,44) | (1,42) | (1,42) |
| Schlussnettoinventarwert | – | 8,44 | 8,46 | 8,47 |
| Gesamtertrag | – | (14,57 %) | (14,37 %) | (14,36 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | – | 0,46 % | 0,25 % | 0,15 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | – | 3,16 % | 2,92 % | 3,02 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Opportunistic Bond

| | Thesaurierende Klasse EUR I € | Thesaurierende Klasse GBP P £ | Thesaurierende Klasse USD A US\$ | Thesaurierende Klasse USD I US\$ | Ausschüttende Klasse USD I US\$ | Thesaurierende Klasse USD I2 US\$ |
|---|-------------------------------------|-------------------------------------|--|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 8,72 | 9,31 | 10,22 | 10,91 | 9,50 | 10,32 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,31 | 0,36 | 0,38 | 0,43 | 0,36 | 0,41 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,65 | 0,16 | 0,23 | 0,25 | 0,22 | 0,24 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,96 | 0,52 | 0,61 | 0,68 | 0,58 | 0,65 |
| Ausschüttungen | – | – | – | – | (0,28) | – |
| Schlussnettoinventarwert | 9,68 | 9,83 | 10,83 | 11,59 | 9,80 | 10,97 |
| Gesamtertrag | 11,01 % | 5,59 % | 5,97 % | 6,23 % | 6,30 % | 6,30 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,51 % | 0,49 % | 0,82 % | 0,51 % | 0,51 % | 0,45 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,47 % | 3,76 % | 3,63 % | 3,83 % | 3,81 % | 3,91 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,08 | 10,59 | 11,59 | 12,32 | 11,02 | 11,65 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,28 | 0,32 | 0,29 | 0,34 | 0,32 | 0,35 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,64) | (1,60) | (1,66) | (1,75) | (1,58) | (1,68) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,36) | (1,28) | (1,37) | (1,41) | (1,26) | (1,33) |
| Ausschüttungen | – | – | – | – | (0,26) | – |
| Schlussnettoinventarwert | 8,72 | 9,31 | 10,22 | 10,91 | 9,50 | 10,32 |
| Gesamtertrag | (13,49 %) | (12,09 %) | (11,82 %) | (11,44 %) | (11,52 %) | (11,42 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,57 % | 0,58 % | 0,94 % | 0,60 % | 0,58 % | 0,51 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,13 % | 3,26 % | 2,76 % | 2,96 % | 3,18 % | 3,25 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Opportunistic Bond (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD Z US\$ |
|---|--|
| 31. Dezember 2023 | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,04 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,42 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,24 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,66 |
| Schlussnettoinventarwert | 10,70 |
| Gesamtertrag | 6,57 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,21 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,14 % |
| 31. Dezember 2022 | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 11,31 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,37 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,64) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,27) |
| Schlussnettoinventarwert | 10,04 |
| Gesamtertrag | (11,23 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,23 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,54 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Real Estate Securities

| | Thesaurierende Klasse EUR M | Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert) | Thesaurierende Klasse GBP Z | Thesaurierende Klasse USD A | Thesaurierende Klasse USD CI | Thesaurierende Klasse USD I |
|---|--------------------------------|---|--------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|
| | € | € | £ | US\$ | US\$ | US\$ |
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,87 | 11,25 | 11,37 | 9,83 | 8,77 | 12,55 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,05 | 0,34 | 0,34 | 0,15 | 0,05 | 0,28 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,25 | 0,20 | 0,50 | 0,53 | 0,46 | 0,68 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,30 | 0,54 | 0,84 | 0,68 | 0,51 | 0,96 |
| Schlussnettoinventarwert | 10,17 | 11,79 | 12,21 | 10,51 | 9,28 | 13,51 |
| Gesamtertrag | 3,04 % | 4,80 % | 7,39 % | 6,92 % | 5,82 % | 7,65 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen
Nettovermögen**

| | | | | | | |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 2,75 % | 0,31 % | 0,31 % | 1,82 % | 2,82 % | 1,06 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,51 % | 3,07 % | 2,97 % | 1,49 % | 0,55 % | 2,23 % |

31. Dezember 2022

| | | | | | | |
|---|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| Eröffnungsnettoinventarwert | 13,96 | 14,07 | 15,48 | 13,30 | 11,98 | 16,86 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,01) | 0,30 | 0,32 | 0,10 | (0,01) | 0,24 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (4,08) | (3,12) | (4,43) | (3,57) | (3,20) | (4,55) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (4,09) | (2,82) | (4,11) | (3,47) | (3,21) | (4,31) |
| Schlussnettoinventarwert | 9,87 | 11,25 | 11,37 | 9,83 | 8,77 | 12,55 |
| Gesamtertrag | (29,30 %) | (20,04 %) | (26,55 %) | (26,09 %) | (26,79 %) | (25,56 %) |

**Verhältnis zum durchschnittlichen
Nettovermögen**

| | | | | | | |
|--------------------------------|----------|--------|--------|--------|----------|--------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 2,77 % | 0,31 % | 0,32 % | 1,82 % | 2,82 % | 1,07 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,11 %) | 2,38 % | 2,44 % | 0,87 % | (0,12 %) | 1,69 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Real Estate Securities (Fortsetzung)

| | Ausschüttende Klasse USD I5 US\$ | Thesaurierende Klasse USD M US\$ | Thesaurierende Klasse USD Z US\$ |
|---|--|--|--|
| 31. Dezember 2023 | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 8,82 | 8,99 | 12,81 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,21 | 0,05 | 0,39 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,49 | 0,47 | 0,69 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,70 | 0,52 | 1,08 |
| Ausschüttungen | (0,21) | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 9,31 | 9,51 | 13,89 |
| Gesamtertrag | 8,14 % | 5,78 % | 8,43 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,69 % | 2,82 % | 0,32 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,39 % | 0,55 % | 3,01 % |
| 31. Dezember 2022 | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 12,03 | 12,29 | 17,07 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,20 | (0,03) | 0,34 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (3,22) | (3,27) | (4,60) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (3,02) | (3,30) | (4,26) |
| Ausschüttungen | (0,19) | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 8,82 | 8,99 | 12,81 |
| Gesamtertrag | (25,27 %) | (26,85 %) | (24,96 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,69 % | 2,82 % | 0,32 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,02 % | (0,29 %) | 2,40 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Sustainable Equity

| | Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) € | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) € | Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert) € | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) £ | Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert) £ | Thesaurierende Klasse USD A US\$ |
|---|--|---|--|--|--|--|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,10 | 9,73 | 9,75 | 9,85 | 9,90 | 7,28 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,02 | (0,18) | 0,05 | (0,01) | 0,02 | (0,08) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 1,99 | 1,88 | 1,92 | 1,65 | 1,67 | 1,72 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 2,01 | 1,70 | 1,97 | 1,64 | 1,69 | 1,64 |
| Schlussnettoinventarwert | 12,11 | 11,43 | 11,72 | 11,49 | 11,59 | 8,92 |
| Gesamtertrag | 19,90 % | 17,47 % | 20,21 % | 16,65 % | 17,07 % | 22,53 % |

**Verhältnis zum
durchschnittlichen
Nettovermögen**

| | | | | | | |
|--------------------------------|--------|----------|--------|----------|--------|----------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,47 % | 2,43 % | 0,17 % | 0,76 % | 0,47 % | 1,67 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,22 % | (1,75 %) | 0,51 % | (0,08 %) | 0,21 % | (0,97 %) |

31. Dezember 2022

| | | | | | | |
|---|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| Eröffnungsnettoinventarwert | 13,18 | 12,96 | 12,68 | 12,20 | 12,22 | 10,24 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,02 | (0,19) | 0,05 | (0,01) | 0,02 | (0,07) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (3,10) | (3,04) | (2,98) | (2,34) | (2,34) | (2,89) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (3,08) | (3,23) | (2,93) | (2,35) | (2,32) | (2,96) |
| Schlussnettoinventarwert | 10,10 | 9,73 | 9,75 | 9,85 | 9,90 | 7,28 |
| Gesamtertrag | (23,37 %) | (24,92 %) | (23,11 %) | (19,26 %) | (18,99 %) | (28,91 %) |

**Verhältnis zum
durchschnittlichen
Nettovermögen**

| | | | | | | |
|--------------------------------|--------|----------|--------|----------|--------|----------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,43 % | 2,40 % | 0,14 % | 0,77 % | 0,45 % | 1,64 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,19 % | (1,80 %) | 0,46 % | (0,06 %) | 0,21 % | (0,95 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Sustainable Equity (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD I US\$ | Ausschüttende Klasse USD I US\$ | Thesaurierende Klasse USD M US\$ | Thesaurierende Klasse USD Z US\$ |
|---|--|---------------------------------------|--|--|
| 31. Dezember 2023 | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 8,83 | 8,84 | 8,54 | 8,32 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,01) | (0,01) | (0,17) | 0,05 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 2,11 | 2,11 | 2,01 | 1,98 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 2,10 | 2,10 | 1,84 | 2,03 |
| Schlussnettoinventarwert | 10,93 | 10,94 | 10,38 | 10,35 |
| Gesamtertrag | 23,78 % | 23,76 % | 21,55 % | 24,40 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,78 % | 0,75 % | 2,48 % | 0,18 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,08 %) | (0,06 %) | (1,78 %) | 0,51 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 12,33 | 12,33 | 12,10 | 10,00 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,01) | (0,01) | (0,18) | 0,01 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (3,49) | (3,48) | (3,38) | (1,69) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (3,50) | (3,49) | (3,56) | (1,68) |
| Schlussnettoinventarwert | 8,83 | 8,84 | 8,54 | 8,32 |
| Gesamtertrag | (28,39 %) | (28,30 %) | (29,42 %) | (16,80 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,74 % | 0,73 % | 2,42 % | 0,20 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,13 %) | (0,10 %) | (1,81 %) | 0,20 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Sustainable Value

| | Thesaurierende Klasse EUR M € | Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert) £ | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)* £ | Thesaurierende Klasse USD A US\$ | Thesaurierende Klasse USD I US\$ | Thesaurierende Klasse USD I3 US\$ |
|---|-------------------------------------|--|---|--|--|---|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 14,02 | 10,08 | 10,00 | 15,83 | 16,71 | 9,47 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,08 | 0,21 | 0,02 | 0,23 | 0,32 | 0,19 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 1,66 | 0,83 | 0,68 | 2,33 | 2,47 | 1,40 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1,74 | 1,04 | 0,70 | 2,56 | 2,79 | 1,59 |
| Schlussnettoinventarwert | 15,76 | 11,12 | 10,70 | 18,39 | 19,50 | 11,06 |
| Gesamtertrag | 12,41 % | 10,32 % | 7,00 % | 16,17 % | 16,70 % | 16,79 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,97 % | 0,51 % | 0,72 % | 1,21 % | 0,77 % | 0,63 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,53 % | 1,98 % | 1,06 % | 1,37 % | 1,77 % | 1,91 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 16,86 | 10,00 | – | 18,26 | 19,19 | 10,00 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,08 | 0,05 | – | 0,22 | 0,35 | 0,10 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (2,92) | 0,03 | – | (2,65) | (2,83) | (0,63) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (2,84) | 0,08 | – | (2,43) | (2,48) | (0,53) |
| Ausschüttungen | – | – | – | – | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 14,02 | 10,08 | – | 15,83 | 16,71 | 9,47 |
| Gesamtertrag | (16,84 %) | 0,80 % | – | (13,31 %) | (12,92 %) | (5,30 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,98 % | 0,53 % | – | 1,22 % | 0,76 % | 0,64 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,51 % | 1,80 % | – | 1,39 % | 2,08 % | 1,80 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Sustainable Value (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD Z US\$ |
|---|--|
| 31. Dezember 2023 | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 18,15 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,44 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 2,69 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 3,13 |
| Schlussnettoinventarwert | 21,28 |
| Gesamtertrag | 17,25 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,31 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,29 % |
| 31. Dezember 2022 | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 20,75 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,42 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (3,02) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (2,60) |
| Schlussnettoinventarwert | 18,15 |
| Gesamtertrag | (12,53 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,32 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,27 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond

| | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) AUD | Thesaurierende Klasse AUD A AUD | Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) AUD | Thesaurierende Klasse AUD B AUD | Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich) AUD | Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) AUD |
|---|---|---------------------------------------|---|---------------------------------------|--|---|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 6,43 | 13,78 | 4,95 | 8,71 | 4,96 | 5,00 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,34 | 0,76 | 0,18 | 0,34 | 0,19 | 0,19 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,20 | 0,46 | 0,16 | 0,28 | 0,15 | 0,15 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,54 | 1,22 | 0,34 | 0,62 | 0,34 | 0,34 |
| Ausschüttungen | (0,47) | – | (0,36) | – | (0,36) | (0,37) |
| Schlussnettoinventarwert | 6,50 | 15,00 | 4,93 | 9,33 | 4,94 | 4,97 |
| Gesamtertrag | 8,87 % | 8,85 % | 7,27 % | 7,12 % | 7,27 % | 7,06 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen
Nettovermögen**

| | | | | | | |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,29 % | 1,29 % | 2,86 % | 2,84 % | 2,91 % | 2,86 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,33 % | 5,33 % | 3,77 % | 3,76 % | 3,78 % | 3,77 % |

31. Dezember 2022

| | | | | | | |
|---|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| Eröffnungsnettoinventarwert | 7,91 | 15,93 | 6,24 | 10,24 | 6,25 | 6,30 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,34 | 0,71 | 0,18 | 0,30 | 0,18 | 0,18 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,39) | (2,86) | (1,09) | (1,83) | (1,09) | (1,09) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,05) | (2,15) | (0,91) | (1,53) | (0,91) | (0,91) |
| Ausschüttungen | (0,43) | – | (0,38) | – | (0,38) | (0,39) |
| Schlussnettoinventarwert | 6,43 | 13,78 | 4,95 | 8,71 | 4,96 | 5,00 |
| Gesamtertrag | (13,52 %) | (13,50 %) | (14,90 %) | (14,94 %) | (14,87 %) | (14,86 %) |

**Verhältnis zum durchschnittlichen
Nettovermögen**

| | | | | | | |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,33 % | 1,34 % | 2,97 % | 2,97 % | 2,97 % | 2,97 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,88 % | 4,86 % | 3,20 % | 3,24 % | 3,16 % | 3,14 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse AUD E AUD | Ausschüttende Klasse AUD I AUD | Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) AUD | Ausschüttende Klasse AUD T (Wöchentlich) AUD | Thesaurierende Klasse AUD T AUD | Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich) CAD |
|---|---------------------------------------|--------------------------------------|---|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,82 | 9,15 | 5,71 | 5,52 | 11,83 | 6,61 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,38 | 0,54 | 0,27 | 0,26 | 0,57 | 0,35 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,32 | 0,29 | 0,18 | 0,17 | 0,40 | 0,27 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,70 | 0,83 | 0,45 | 0,43 | 0,97 | 0,62 |
| Ausschüttungen | – | (0,54) | (0,42) | (0,40) | – | (0,49) |
| Schlussnettoinventarwert | 10,52 | 9,44 | 5,74 | 5,55 | 12,80 | 6,74 |
| Gesamtertrag | 7,13 % | 9,56 % | 8,27 % | 8,16 % | 8,20 % | 9,80 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 2,86 % | 0,70 % | 1,87 % | 1,87 % | 1,87 % | 1,29 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,77 % | 5,92 % | 4,74 % | 4,74 % | 4,73 % | 5,34 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 11,54 | 11,10 | 7,13 | 6,89 | 13,75 | 8,06 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,33 | 0,54 | 0,27 | 0,26 | 0,53 | 0,35 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (2,05) | (1,96) | (1,25) | (1,21) | (2,45) | (1,36) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,72) | (1,42) | (0,98) | (0,95) | (1,92) | (1,01) |
| Ausschüttungen | – | (0,53) | (0,44) | (0,42) | – | (0,44) |
| Schlussnettoinventarwert | 9,82 | 9,15 | 5,71 | 5,52 | 11,83 | 6,61 |
| Gesamtertrag | (14,90 %) | (13,01 %) | (14,09 %) | (14,08 %) | (13,96 %) | (12,76 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 2,98 % | 0,73 % | 1,95 % | 1,95 % | 1,94 % | 1,36 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,01 % | 5,39 % | 4,27 % | 4,25 % | 4,38 % | 4,96 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse CHF A CHF | Thesaurierende Klasse CHF I CHF | Thesaurierende Klasse CHF I2 CHF | Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) CNY | Ausschüttende Klasse CNY I (Monatlich) CNY | Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) € |
|---|---------------------------------------|---------------------------------------|--|---|---|---|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 11,47 | 12,22 | 10,47 | 73,25 | 77,39 | 6,03 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,60 | 0,67 | 0,62 | 3,96 | 4,63 | 0,32 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,11 | 0,17 | 0,11 | 1,31 | 1,41 | 0,15 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,71 | 0,84 | 0,73 | 5,27 | 6,04 | 0,47 |
| Ausschüttungen | – | – | – | (5,34) | (5,65) | (0,44) |
| Schlussnettoinventarwert | 12,18 | 13,06 | 11,20 | 73,18 | 77,78 | 6,06 |
| Gesamtertrag | 6,19 % | 6,87 % | 6,97 % | 7,57 % | 8,22 % | 8,22 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,24 % | 0,65 % | 0,58 % | 1,32 % | 0,71 % | 1,29 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,12 % | 5,35 % | 5,80 % | 5,48 % | 6,06 % | 5,36 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 13,46 | 14,25 | 12,20 | 89,36 | 93,83 | 7,53 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,56 | 0,68 | 0,59 | 3,89 | 4,72 | 0,31 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (2,55) | (2,71) | (2,32) | (14,15) | (15,00) | (1,40) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,99) | (2,03) | (1,73) | (10,26) | (10,28) | (1,09) |
| Ausschüttungen | – | – | – | (5,85) | (6,16) | (0,41) |
| Schlussnettoinventarwert | 11,47 | 12,22 | 10,47 | 73,25 | 77,39 | 6,03 |
| Gesamtertrag | (14,78 %) | (14,25 %) | (14,18 %) | (11,77 %) | (11,23 %) | (14,81 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,27 % | 0,66 % | 0,59 % | 1,35 % | 0,74 % | 1,29 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,63 % | 5,56 % | 5,30 % | 4,93 % | 5,05 % | 4,66 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse EUR A € | Ausschüttende Klasse EUR A € | Thesaurierende Klasse EUR I € | Ausschüttende Klasse EUR I € | Thesaurierende Klasse EUR I2 € | Ausschüttende Klasse EUR I2 € |
|---|-------------------------------------|------------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 18,42 | 7,01 | 16,30 | 6,74 | 11,44 | 6,65 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 1,01 | 0,37 | 1,00 | 0,40 | 0,72 | 0,40 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,51 | 0,18 | 0,46 | 0,18 | 0,31 | 0,17 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1,52 | 0,55 | 1,46 | 0,58 | 1,03 | 0,57 |
| Ausschüttungen | – | (0,37) | – | (0,40) | – | (0,40) |
| Schlussnettoinventarwert | 19,94 | 7,19 | 17,76 | 6,92 | 12,47 | 6,82 |
| Gesamtertrag | 8,25 % | 8,25 % | 8,96 % | 9,01 % | 9,00 % | 9,00 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,28 % | 1,29 % | 0,70 % | 0,71 % | 0,61 % | 0,61 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,34 % | 5,35 % | 5,93 % | 5,94 % | 6,07 % | 6,06 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 21,61 | 8,62 | 19,02 | 8,30 | 13,33 | 8,19 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,92 | 0,36 | 0,92 | 0,39 | 0,65 | 0,38 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (4,11) | (1,61) | (3,64) | (1,56) | (2,54) | (1,53) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (3,19) | (1,25) | (2,72) | (1,17) | (1,89) | (1,15) |
| Ausschüttungen | – | (0,36) | – | (0,39) | – | (0,39) |
| Schlussnettoinventarwert | 18,42 | 7,01 | 16,30 | 6,74 | 11,44 | 6,65 |
| Gesamtertrag | (14,76 %) | (14,73 %) | (14,30 %) | (14,32 %) | (14,18 %) | (14,23 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,28 % | 1,29 % | 0,69 % | 0,70 % | 0,59 % | 0,56 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,70 % | 4,70 % | 5,31 % | 5,22 % | 5,46 % | 5,95 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse EUR M | Thesaurierende Klasse EUR Z | Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich) | Thesaurierende Klasse GBP A | Ausschüttende Klasse GBP A | Thesaurierende Klasse GBP I |
|---|--------------------------------|--------------------------------|--|--------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|
| | € | € | £ | £ | £ | £ |
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,36 | 10,87 | 6,20 | 12,91 | 7,59 | 15,62 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,51 | 0,73 | 0,33 | 0,71 | 0,41 | 0,96 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,28 | 0,30 | 0,27 | 0,58 | 0,32 | 0,71 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,79 | 1,03 | 0,60 | 1,29 | 0,73 | 1,67 |
| Ausschüttungen | – | – | (0,46) | – | (0,41) | – |
| Schlussnettoinventarwert | 11,15 | 11,90 | 6,34 | 14,20 | 7,91 | 17,29 |
| Gesamtertrag | 7,63 % | 9,48 % | 10,12 % | 9,99 % | 9,98 % | 10,69 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,88 % | 0,12 % | 1,29 % | 1,29 % | 1,29 % | 0,70 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,77 % | 6,53 % | 5,34 % | 5,32 % | 5,34 % | 5,92 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 12,23 | 12,60 | 7,60 | 14,87 | 9,18 | 17,89 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,46 | 0,67 | 0,33 | 0,66 | 0,40 | 0,90 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (2,33) | (2,40) | (1,31) | (2,62) | (1,60) | (3,17) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,87) | (1,73) | (0,98) | (1,96) | (1,20) | (2,27) |
| Ausschüttungen | – | – | (0,42) | – | (0,39) | – |
| Schlussnettoinventarwert | 10,36 | 10,87 | 6,20 | 12,91 | 7,59 | 15,62 |
| Gesamtertrag | (15,29 %) | (13,73 %) | (13,21 %) | (13,18 %) | (13,27 %) | (12,69 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,86 % | 0,10 % | 1,34 % | 1,34 % | 1,34 % | 0,72 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,17 % | 5,90 % | 4,82 % | 4,90 % | 4,86 % | 5,52 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

| | Ausschüttende Klasse GBP I | Thesaurierende Klasse GBP I2 | Ausschüttende Klasse GBP I2 | Thesaurierende Klasse GBP Z | Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) | Thesaurierende Klasse SEK A |
|---|-------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--|--------------------------------|
| | £ | £ | £ | £ | HKD | SEK |
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 8,21 | 12,49 | 7,27 | 12,06 | 6,53 | 125,59 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,49 | 0,79 | 0,44 | 0,82 | 0,35 | 7,44 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,34 | 0,56 | 0,30 | 0,54 | 0,25 | 3,00 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,83 | 1,35 | 0,74 | 1,36 | 0,60 | 10,44 |
| Ausschüttungen | (0,49) | – | (0,44) | – | (0,48) | – |
| Schlussnettoinventarwert | 8,55 | 13,84 | 7,57 | 13,42 | 6,65 | 136,03 |
| Gesamtertrag | 10,56 % | 10,81 % | 10,66 % | 11,28 % | 9,62 % | 8,31 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,70 % | 0,61 % | 0,61 % | 0,12 % | 1,32 % | 1,34 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,90 % | 6,05 % | 6,04 % | 6,50 % | 5,46 % | 5,74 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,93 | 14,29 | 8,79 | 13,72 | 7,97 | 146,45 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,49 | 0,73 | 0,43 | 0,77 | 0,33 | 6,55 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,73) | (2,53) | (1,52) | (2,43) | (1,33) | (27,41) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,24) | (1,80) | (1,09) | (1,66) | (1,00) | (20,86) |
| Ausschüttungen | (0,48) | – | (0,43) | – | (0,44) | – |
| Schlussnettoinventarwert | 8,21 | 12,49 | 7,27 | 12,06 | 6,53 | 125,59 |
| Gesamtertrag | (12,72 %) | (12,60 %) | (12,59 %) | (12,10 %) | (12,84 %) | (14,24 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,73 % | 0,62 % | 0,60 % | 0,11 % | 1,30 % | 1,34 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,42 % | 5,61 % | 5,92 % | 6,19 % | 4,79 % | 4,91 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

| | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) SGD | Thesaurierende Klasse SGD A SGD | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) US\$ | Ausschüttende Klasse USD A (Wöchentlich) US\$ | Thesaurierende Klasse USD A US\$ | Ausschüttende Klasse USD A US\$ |
|---|---|---------------------------------------|--|--|--|---------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 13,65 | 26,58 | 6,93 | 6,65 | 16,32 | 8,20 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,73 | 1,48 | 0,38 | 0,36 | 0,93 | 0,45 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,45 | 0,95 | 0,33 | 0,32 | 0,82 | 0,39 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1,18 | 2,43 | 0,71 | 0,68 | 1,75 | 0,84 |
| Ausschüttungen | (1,00) | – | (0,51) | (0,49) | – | (0,44) |
| Schlussnettoinventarwert | 13,83 | 29,01 | 7,13 | 6,84 | 18,07 | 8,60 |
| Gesamtertrag | 9,09 % | 9,14 % | 10,74 % | 10,65 % | 10,72 % | 10,72 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,30 % | 1,30 % | 1,32 % | 1,32 % | 1,32 % | 1,32 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,37 % | 5,37 % | 5,47 % | 5,47 % | 5,47 % | 5,47 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 16,64 | 30,46 | 8,42 | 8,07 | 18,63 | 9,80 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,68 | 1,29 | 0,35 | 0,34 | 0,81 | 0,41 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (2,76) | (5,17) | (1,38) | (1,32) | (3,12) | (1,61) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (2,08) | (3,88) | (1,03) | (0,98) | (2,31) | (1,20) |
| Ausschüttungen | (0,91) | – | (0,46) | (0,44) | – | (0,40) |
| Schlussnettoinventarwert | 13,65 | 26,58 | 6,93 | 6,65 | 16,32 | 8,20 |
| Gesamtertrag | (12,73 %) | (12,74 %) | (12,45 %) | (12,35 %) | (12,40 %) | (12,37 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,27 % | 1,27 % | 1,31 % | 1,30 % | 1,31 % | 1,31 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,65 % | 4,65 % | 4,76 % | 4,87 % | 4,79 % | 4,76 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

| | Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) US\$ | Thesaurierende Klasse USD B US\$ | Thesaurierende Klasse USD C US\$ | Thesaurierende Klasse USD C1 US\$ | Ausschüttende Klasse USD C1 US\$ | Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich) US\$ |
|---|--|--|--|---|--|---|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 5,38 | 10,88 | 12,07 | 9,85 | 8,29 | 5,38 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,21 | 0,43 | 0,61 | 0,45 | 0,37 | 0,21 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,25 | 0,54 | 0,60 | 0,50 | 0,39 | 0,24 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,46 | 0,97 | 1,21 | 0,95 | 0,76 | 0,45 |
| Ausschüttungen | (0,39) | – | – | – | (0,36) | (0,39) |
| Schlussnettoinventarwert | 5,45 | 11,85 | 13,28 | 10,80 | 8,69 | 5,44 |
| Gesamtertrag | 9,04 % | 8,92 % | 10,02 % | 9,64 % | 9,55 % | 8,84 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 2,92 % | 2,92 % | 1,92 % | 2,32 % | 2,32 % | 2,93 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,87 % | 3,86 % | 4,87 % | 4,47 % | 4,47 % | 3,82 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 6,70 | 12,61 | 13,86 | 11,36 | 9,90 | 6,70 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,19 | 0,36 | 0,53 | 0,39 | 0,33 | 0,18 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,10) | (2,09) | (2,32) | (1,90) | (1,62) | (1,09) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (0,91) | (1,73) | (1,79) | (1,51) | (1,29) | (0,91) |
| Ausschüttungen | (0,41) | – | – | – | (0,32) | (0,41) |
| Schlussnettoinventarwert | 5,38 | 10,88 | 12,07 | 9,85 | 8,29 | 5,38 |
| Gesamtertrag | (13,86 %) | (13,72 %) | (12,91 %) | (13,29 %) | (13,20 %) | (13,86 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 2,91 % | 2,91 % | 1,91 % | 2,31 % | 2,31 % | 2,91 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,18 % | 3,16 % | 4,19 % | 3,79 % | 3,78 % | 3,14 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD C2 US\$ | Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) US\$ | Thesaurierende Klasse USD E US\$ | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) US\$ | Thesaurierende Klasse USD I US\$ | Ausschüttende Klasse USD I US\$ |
|---|---|--|--|--|--|---------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,89 | 5,46 | 9,81 | 7,20 | 24,73 | 9,48 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,43 | 0,21 | 0,39 | 0,44 | 1,56 | 0,58 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,54 | 0,26 | 0,49 | 0,34 | 1,25 | 0,45 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,97 | 0,47 | 0,88 | 0,78 | 2,81 | 1,03 |
| Ausschüttungen | – | (0,40) | – | (0,53) | – | (0,57) |
| Schlussnettoinventarwert | 11,86 | 5,53 | 10,69 | 7,45 | 27,54 | 9,94 |
| Gesamtertrag | 8,91 % | 9,02 % | 8,97 % | 11,37 % | 11,36 % | 11,36 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 2,94 % | 2,92 % | 2,93 % | 0,72 % | 0,72 % | 0,72 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,86 % | 3,87 % | 3,85 % | 6,06 % | 6,06 % | 6,06 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 12,63 | 6,79 | 11,38 | 8,69 | 28,05 | 11,34 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,36 | 0,19 | 0,33 | 0,41 | 1,38 | 0,54 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (2,10) | (1,10) | (1,90) | (1,42) | (4,70) | (1,87) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,74) | (0,91) | (1,57) | (1,01) | (3,32) | (1,33) |
| Ausschüttungen | – | (0,42) | – | (0,48) | – | (0,53) |
| Schlussnettoinventarwert | 10,89 | 5,46 | 9,81 | 7,20 | 24,73 | 9,48 |
| Gesamtertrag | (13,78 %) | (13,73 %) | (13,80 %) | (11,86 %) | (11,84 %) | (11,90 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 2,91 % | 2,91 % | 2,91 % | 0,71 % | 0,70 % | 0,71 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,18 % | 3,18 % | 3,18 % | 5,38 % | 5,42 % | 5,31 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

| | Ausschüttende Klasse USD I2 (Monatlich) US\$ | Thesaurierende Klasse USD I2 US\$ | Ausschüttende Klasse USD I2 US\$ | Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich) US\$ | Thesaurierende Klasse USD M US\$ | Ausschüttende Klasse USD M US\$ |
|---|---|---|--|---|--|---------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 8,09 | 13,53 | 7,91 | 8,88 | 12,12 | 7,79 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,50 | 0,87 | 0,49 | 0,57 | 0,61 | 0,38 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,39 | 0,68 | 0,38 | 0,43 | 0,61 | 0,36 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,89 | 1,55 | 0,87 | 1,00 | 1,22 | 0,74 |
| Ausschüttungen | (0,60) | – | (0,48) | (0,46) | – | (0,52) |
| Schlussnettoinventarwert | 8,38 | 15,08 | 8,30 | 9,42 | 13,34 | 8,01 |
| Gesamtertrag | 11,49 % | 11,46 % | 11,55 % | 11,63 % | 10,07 % | 10,05 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,62 % | 0,62 % | 0,62 % | 0,48 % | 1,92 % | 1,92 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 6,17 % | 6,17 % | 6,19 % | 6,31 % | 4,87 % | 4,89 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,76 | 15,33 | 9,46 | 10,56 | 13,92 | 9,49 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,47 | 0,77 | 0,46 | 0,53 | 0,53 | 0,35 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,60) | (2,57) | (1,56) | (1,75) | (2,33) | (1,55) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,13) | (1,80) | (1,10) | (1,22) | (1,80) | (1,20) |
| Ausschüttungen | (0,54) | – | (0,45) | (0,46) | – | (0,50) |
| Schlussnettoinventarwert | 8,09 | 13,53 | 7,91 | 8,88 | 12,12 | 7,79 |
| Gesamtertrag | (11,82 %) | (11,74 %) | (11,79 %) | (11,71 %) | (12,93 %) | (12,84 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,61 % | 0,61 % | 0,60 % | 0,47 % | 1,91 % | 1,91 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,50 % | 5,47 % | 5,62 % | 5,65 % | 4,20 % | 4,19 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD P US\$ | Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) US\$ | Ausschüttende Klasse USD T (Wöchentlich) US\$ | Thesaurierende Klasse USD T US\$ | Ausschüttende Klasse USD U (Monatlich) US\$ | Thesaurierende Klasse USD U US\$ |
|---|--|--|--|--|--|--|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,67 | 5,95 | 5,99 | 12,02 | 6,77 | 13,22 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,67 | 0,29 | 0,29 | 0,61 | 0,39 | 0,79 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,55 | 0,28 | 0,28 | 0,60 | 0,32 | 0,67 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1,22 | 0,57 | 0,57 | 1,21 | 0,71 | 1,46 |
| Ausschüttungen | – | (0,44) | (0,44) | – | (0,50) | – |
| Schlussnettoinventarwert | 11,89 | 6,08 | 6,12 | 13,23 | 6,98 | 14,68 |
| Gesamtertrag | 11,43 % | 9,99 % | 9,91 % | 10,07 % | 10,97 % | 11,04 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,69 % | 1,92 % | 1,92 % | 1,92 % | 1,02 % | 1,02 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 6,05 % | 4,87 % | 4,87 % | 4,88 % | 5,77 % | 5,75 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 12,10 | 7,33 | 7,37 | 13,80 | 8,20 | 15,05 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,60 | 0,27 | 0,27 | 0,53 | 0,37 | 0,70 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (2,03) | (1,20) | (1,20) | (2,31) | (1,35) | (2,53) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,43) | (0,93) | (0,93) | (1,78) | (0,98) | (1,83) |
| Ausschüttungen | – | (0,45) | (0,45) | – | (0,45) | – |
| Schlussnettoinventarwert | 10,67 | 5,95 | 5,99 | 12,02 | 6,77 | 13,22 |
| Gesamtertrag | (11,82 %) | (12,92 %) | (12,83 %) | (12,90 %) | (12,17 %) | (12,16 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,68 % | 1,91 % | 1,91 % | 1,91 % | 1,00 % | 1,01 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,37 % | 4,20 % | 4,19 % | 4,20 % | 5,11 % | 5,09 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD Z US\$ | Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich) ZAR | Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich) ZAR | Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) ZAR | Thesaurierende Klasse ZAR E ZAR | Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) ZAR |
|---|--|---|--|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 12,65 | 53,76 | 53,71 | 53,15 | 148,94 | 59,48 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,88 | 2,04 | 2,06 | 2,02 | 5,96 | 2,85 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,64 | 3,93 | 3,90 | 3,88 | 11,77 | 4,38 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1,52 | 5,97 | 5,96 | 5,90 | 17,73 | 7,23 |
| Ausschüttungen | – | (5,80) | (5,79) | (5,73) | – | (6,44) |
| Schlussnettoinventarwert | 14,17 | 53,93 | 53,88 | 53,32 | 166,67 | 60,27 |
| Gesamtertrag | 12,02 % | 11,90 % | 11,90 % | 11,90 % | 11,90 % | 13,02 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,12 % | 2,90 % | 2,96 % | 2,91 % | 2,91 % | 1,91 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 6,65 % | 3,84 % | 3,85 % | 3,85 % | 3,84 % | 4,83 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 14,26 | 67,31 | 67,24 | 66,55 | 166,84 | 73,73 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,78 | 1,94 | 1,94 | 1,92 | 5,09 | 2,81 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (2,39) | (8,93) | (8,92) | (8,83) | (22,99) | (9,84) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,61) | (6,99) | (6,98) | (6,91) | (17,90) | (7,03) |
| Ausschüttungen | – | (6,56) | (6,55) | (6,49) | – | (7,22) |
| Schlussnettoinventarwert | 12,65 | 53,76 | 53,71 | 53,15 | 148,94 | 59,48 |
| Gesamtertrag | (11,29 %) | (10,73 %) | (10,72 %) | (10,73 %) | (10,73 %) | (9,83 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,11 % | 3,02 % | 3,02 % | 3,02 % | 3,02 % | 1,98 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,98 % | 3,26 % | 3,20 % | 3,23 % | 3,21 % | 4,33 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse ZAR T ZAR |
|---|---------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 137,52 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 6,98 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 10,94 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 17,92 |
| Schlussnettoinventarwert | 155,44 |
| Gesamtertrag | 13,03 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,90 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,83 % |
| 31. Dezember 2022 | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 152,51 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 6,16 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (21,15) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (14,99) |
| Schlussnettoinventarwert | 137,52 |
| Gesamtertrag | (9,83 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,98 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,34 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

InnovAsia 5G

| | Thesaurierende Klasse CHF I4 | Thesaurierende Klasse EUR A | Thesaurierende Klasse EUR I4 | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | Thesaurierende Klasse EUR X | Thesaurierende Klasse SGD A |
|--|---------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|--|--------------------------------|--------------------------------|
| | CHF | € | € | € | € | SGD |
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 6,39 | 6,32 | 6,42 | 7,58 | 6,33 | 12,97 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,04 | (0,04) | 0,04 | (0,12) | (0,03) | (0,10) |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 1,67 | 1,79 | 1,84 | 2,04 | 1,81 | 3,81 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1,71 | 1,75 | 1,88 | 1,92 | 1,78 | 3,71 |
| Schlussnettoinventarwert | 8,10 | 8,07 | 8,30 | 9,50 | 8,11 | 16,68 |
| Gesamtertrag | 26,76 % | 27,69 % | 29,28 % | 25,33 % | 28,12 % | 28,60 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,68 % | 1,88 % | 0,71 % | 2,66 % | 1,63 % | 1,88 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,50 % | (0,54 %) | 0,53 % | (1,43 %) | (0,40 %) | (0,65 %) |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,86 | 10,82 | 10,88 | 11,94 | 10,83 | 21,75 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,03 | (0,05) | 0,04 | (0,13) | (0,03) | (0,10) |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (4,50) | (4,45) | (4,50) | (4,23) | (4,47) | (8,68) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (4,47) | (4,50) | (4,46) | (4,36) | (4,50) | (8,78) |
| Schlussnettoinventarwert | 6,39 | 6,32 | 6,42 | 7,58 | 6,33 | 12,97 |
| Gesamtertrag | (41,16 %) | (41,59 %) | (40,99 %) | (36,52 %) | (41,55 %) | (40,37 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,70 % | 1,89 % | 0,72 % | 2,67 % | 1,64 % | 1,86 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,45 % | (0,68 %) | 0,51 % | (1,46 %) | (0,43 %) | (0,65 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

InnovAsia 5G (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse SGD I4 SGD | Thesaurierende Klasse SGD X SGD | Thesaurierende Klasse USD A US\$ | Thesaurierende Klasse USD I US\$ | Thesaurierende Klasse USD I4 US\$ | Thesaurierende Klasse USD M US\$ |
|---|--|---------------------------------------|--|--|---|--|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 13,20 | 13,02 | 6,55 | 6,64 | 6,67 | 6,26 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,08 | (0,06) | (0,05) | 0,02 | 0,04 | (0,11) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 3,90 | 3,82 | 2,07 | 2,10 | 2,12 | 1,98 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 3,98 | 3,76 | 2,02 | 2,12 | 2,16 | 1,87 |
| Schlussnettoinventarwert | 17,18 | 16,78 | 8,57 | 8,76 | 8,83 | 8,13 |
| Gesamtertrag | 30,15 % | 28,88 % | 30,84 % | 31,93 % | 32,38 % | 29,87 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,71 % | 1,64 % | 1,90 % | 1,07 % | 0,73 % | 2,71 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,53 % | (0,41 %) | (0,67 %) | 0,21 % | 0,52 % | (1,46 %) |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 21,88 | 21,78 | 10,90 | 10,95 | 10,97 | 10,51 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,08 | (0,06) | (0,05) | 0,03 | 0,04 | (0,10) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (8,76) | (8,70) | (4,30) | (4,34) | (4,34) | (4,15) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (8,68) | (8,76) | (4,35) | (4,31) | (4,30) | (4,25) |
| Schlussnettoinventarwert | 13,20 | 13,02 | 6,55 | 6,64 | 6,67 | 6,26 |
| Gesamtertrag | (39,67 %) | (40,22 %) | (39,91 %) | (39,36 %) | (39,20 %) | (40,44 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,71 % | 1,62 % | 1,92 % | 1,07 % | 0,73 % | 2,71 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,51 % | (0,40 %) | (0,70 %) | 0,35 % | 0,49 % | (1,45 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

InnovAsia 5G (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD X US\$ |
|---|--|
| 31. Dezember 2023 | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 6,58 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,03) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 2,08 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 2,05 |
| Schlussnettoinventarwert | 8,63 |
| Gesamtertrag | 31,16 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,67 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,41 %) |
| 31. Dezember 2022 | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,92 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,03) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (4,31) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (4,34) |
| Schlussnettoinventarwert | 6,58 |
| Gesamtertrag | (39,74 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,67 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,37 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Japanischen Aktienengagement

| | Ausschüttende Klasse EUR I5 | Thesaurierende Klasse GBP I5 | Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)* | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | Thesaurierende Klasse JPY I | Ausschüttende Klasse JPY I |
|---|--------------------------------|---------------------------------|---|---|--------------------------------|-------------------------------|
| | € | £ | £ | £ | ¥ | ¥ |
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,46 | 8,13 | 10,00 | 7,89 | 1.450,08 | 1.450,06 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,13 | 0,10 | 0,07 | 0,10 | 7,38 | (8,31) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 2,51 | 2,09 | 0,71 | 0,40 | 285,07 | 298,39 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 2,64 | 2,19 | 0,78 | 0,50 | 292,45 | 290,08 |
| Ausschüttungen | (0,12) | – | – | – | – | (10,90) |
| Schlussnettoinventarwert | 11,98 | 10,32 | 10,78 | 8,39 | 1.742,53 | 1.729,24 |
| Gesamtertrag | 28,28 % | 26,94 % | 7,80 % | 6,34 % | 20,17 % | 20,17 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,55 % | 0,59 % | 0,70 % | 1,10 % | 1,06 % | 0,98 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 1,27 % | 1,13 % | 1,40 % | 1,29 % | 0,46 % | (0,55 %) |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,00 | 9,34 | – | 9,39 | 1.688,22 | 1.688,38 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,12 | 0,09 | – | 0,06 | 11,01 | 10,33 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (0,66) | (1,30) | – | (1,56) | (249,15) | (248,65) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (0,54) | (1,21) | – | (1,50) | (238,14) | (238,32) |
| Schlussnettoinventarwert | 9,46 | 8,13 | – | 7,89 | 1.450,08 | 1.450,06 |
| Gesamtertrag | (5,40 %) | (12,96 %) | – | (15,97 %) | (14,18 %) | (14,18 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,56 % | 0,60 % | – | 1,00 % | 1,02 % | 1,00 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 1,41 % | 1,12 % | – | 0,78 % | 0,73 % | 0,69 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Japan Equity Engagement (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse JPY I5 ¥ | Thesaurierende Klasse JPY Z ¥ |
|---|--------------------------------------|-------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9.380,86 | 922,43 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 133,80 | 15,96 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 1.805,98 | 179,52 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1.939,78 | 195,48 |
| Schlussnettoinventarwert | 11.320,64 | 1.117,91 |
| Gesamtertrag | 20,68 % | 21,19 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,62 % | 0,17 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 1,28 % | 1,56 % |
| 31. Dezember 2022 | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10.883,95 | 1.065,69 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 130,14 | 19,75 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1.633,23) | (163,01) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1.503,09) | (143,26) |
| Schlussnettoinventarwert | 9.380,86 | 922,43 |
| Gesamtertrag | (13,81 %) | (13,44 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,60 % | 0,34 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 1,34 % | 2,06 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Macro Opportunities FX

| | Thesaurierende Klasse EUR I € | Thesaurierende Klasse GBP Z £ | Thesaurierende Klasse SEK I SEK | Ausschüttende Klasse SEK I SEK | Thesaurierende Klasse USD I US\$ | Thesaurierende Klasse USD Z US\$ |
|---|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|--|--|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,23 | 9,71 | 93,64 | 96,89 | 9,66 | 9,84 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,03) | 0,04 | (0,20) | (0,23) | (0,03) | 0,04 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,33 | 0,50 | 3,48 | 3,61 | 0,58 | 0,58 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,30 | 0,54 | 3,28 | 3,38 | 0,55 | 0,62 |
| Ausschüttungen | – | – | – | (0,07) | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 9,53 | 10,25 | 96,92 | 100,20 | 10,21 | 10,46 |
| Gesamtertrag | 3,25 % | 5,56 % | 3,50 % | 3,49 % | 5,69 % | 6,30 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen
Nettovermögen**

| | | | | | | |
|--------------------------------|----------|--------|----------|----------|----------|--------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,82 % | 0,21 % | 0,79 % | 0,80 % | 0,84 % | 0,22 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,27 %) | 0,38 % | (0,21 %) | (0,24 %) | (0,27 %) | 0,41 % |

31. Dezember 2022

| | | | | | | |
|---|----------|----------|----------|----------|----------|--------|
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,47 | 9,73 | 95,49 | 98,77 | 9,71 | 9,84 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,01 | 0,07 | 0,07 | 0,17 | 0,01 | 0,07 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (0,25) | (0,09) | (1,92) | (1,97) | (0,06) | (0,07) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (0,24) | (0,02) | (1,85) | (1,80) | (0,05) | 0,00 |
| Ausschüttungen | – | – | – | (0,08) | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 9,23 | 9,71 | 93,64 | 96,89 | 9,66 | 9,84 |
| Gesamtertrag | (2,53 %) | (0,21 %) | (1,94 %) | (1,83 %) | (0,51 %) | 0,00 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen
Nettovermögen**

| | | | | | | |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,82 % | 0,22 % | 0,85 % | 0,85 % | 0,82 % | 0,22 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,13 % | 0,72 % | 0,08 % | 0,17 % | 0,10 % | 0,66 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Next Generation Mobility

| | Thesaurierende Klasse EUR A | Thesaurierende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | Thesaurierende Klasse USD A | Thesaurierende Klasse USD C1 |
|---|--------------------------------|--------------------------------|---|--|--------------------------------|---------------------------------|
| | € | € | € | € | US\$ | US\$ |
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 11,62 | 8,21 | 13,43 | 15,72 | 13,10 | 14,16 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,11) | 0,00 | 0,00 | (0,29) | (0,13) | (0,30) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 3,03 | 2,15 | 3,37 | 3,91 | 3,85 | 4,13 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 2,92 | 2,15 | 3,37 | 3,62 | 3,72 | 3,83 |
| Schlussnettoinventarwert | 14,54 | 10,36 | 16,80 | 19,34 | 16,82 | 17,99 |
| Gesamtertrag | 25,13 % | 26,19 % | 25,09 % | 23,03 % | 28,40 % | 27,05 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,85 % | 1,01 % | 1,02 % | 2,64 % | 1,90 % | 2,90 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,84 %) | 0,01 % | 0,00 | (1,61 %) | (0,85 %) | (1,84 %) |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 16,56 | 11,60 | 17,08 | 20,33 | 17,91 | 19,54 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,14) | (0,02) | (0,03) | (0,32) | (0,15) | (0,33) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (4,80) | (3,37) | (3,62) | (4,29) | (4,66) | (5,05) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (4,94) | (3,39) | (3,65) | (4,61) | (4,81) | (5,38) |
| Schlussnettoinventarwert | 11,62 | 8,21 | 13,43 | 15,72 | 13,10 | 14,16 |
| Gesamtertrag | (29,83 %) | (29,22 %) | (21,37 %) | (22,68 %) | (26,86 %) | (27,53 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,86 % | 1,02 % | 1,03 % | 2,65 % | 1,90 % | 2,89 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (1,05 %) | (0,21 %) | (0,20 %) | (1,82 %) | (1,05 %) | (2,09 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Next Generation Mobility (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD I US\$ | Ausschüttende Klasse USD I US\$ | Thesaurierende Klasse USD M US\$ | Thesaurierende Klasse USD X US\$ |
|---|--|---------------------------------------|--|--|
| 31. Dezember 2023 | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 13,25 | 13,24 | 14,25 | 15,48 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,00 | 0,00 | (0,27) | (0,12) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 3,90 | 3,90 | 4,18 | 4,54 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 3,90 | 3,90 | 3,91 | 4,42 |
| Schlussnettoinventarwert | 17,15 | 17,14 | 18,16 | 19,90 |
| Gesamtertrag | 29,43 % | 29,46 % | 27,44 % | 28,55 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,05 % | 1,05 % | 2,70 % | 1,74 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,02 % | 0,00 | (1,64 %) | (0,70 %) |
| 31. Dezember 2022 | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 17,96 | 17,94 | 19,64 | 21,13 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,04) | (0,03) | (0,29) | (0,15) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (4,67) | (4,67) | (5,10) | (5,50) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (4,71) | (4,70) | (5,39) | (5,65) |
| Schlussnettoinventarwert | 13,25 | 13,24 | 14,25 | 15,48 |
| Gesamtertrag | (26,22 %) | (26,20 %) | (27,44 %) | (26,74 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,04 % | 1,05 % | 2,69 % | 1,74 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,25 %) | (0,21 %) | (1,85 %) | (0,90 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Next Generation Space Economy²

| | Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert) € | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) € | Thesaurierende Klasse USD I US\$ |
|--|--|---|--|
| 31. Dezember 2023 | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,51 | 9,39 | 9,61 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,03 | (0,16) | 0,01 |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 2,18 | 2,13 | 2,61 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 2,21 | 1,97 | 2,62 |
| Schlussnettoinventarwert | 11,72 | 11,36 | 12,23 |
| Gesamtertrag | 23,24 % | 20,98 % | 27,26 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,79 % | 2,66 % | 1,06 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,32 % | (1,53 %) | 0,06 % |
| 31. Dezember 2022 | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,00 | 10,00 | 10,00 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,05 | (0,08) | 0,02 |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (0,54) | (0,53) | (0,41) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (0,49) | (0,61) | (0,39) |
| Schlussnettoinventarwert | 9,51 | 9,39 | 9,61 |
| Gesamtertrag | (4,90 %) | (6,10 %) | (3,90 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,68 % | 2,50 % | 0,96 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,86 % | (1,15 %) | 0,43 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Responsible Asian Debt – Hard Currency

| | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) US\$ | Thesaurierende Klasse USD A US\$ | Thesaurierende Klasse USD C1 US\$ | Thesaurierende Klasse USD I US\$ | Ausschüttende Klasse USD I US\$ | Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich) US\$ |
|---|--|--|---|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 7,83 | 10,99 | 8,68 | 11,47 | 8,96 | 10,12 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,24 | 0,35 | 0,19 | 0,44 | 0,42 | 0,40 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,20 | 0,29 | 0,22 | 0,30 | 0,14 | 0,25 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,44 | 0,64 | 0,41 | 0,74 | 0,56 | 0,65 |
| Ausschüttungen | (0,49) | – | – | – | (0,31) | (0,63) |
| Schlussnettoinventarwert | 7,78 | 11,63 | 9,09 | 12,21 | 9,21 | 10,14 |
| Gesamtertrag | 5,82 % | 5,82 % | 4,72 % | 6,45 % | 6,46 % | 6,70 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,36 % | 1,36 % | 2,36 % | 0,76 % | 1,05 % | 0,52 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,12 % | 3,12 % | 2,10 % | 3,72 % | 4,80 % | 3,96 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,54 | 12,77 | 10,19 | 13,26 | 10,70 | 10,00 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,24 | 0,32 | 0,17 | 0,41 | 0,31 | 0,10 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,56) | (2,10) | (1,68) | (2,20) | (1,70) | 0,13 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,32) | (1,78) | (1,51) | (1,79) | (1,39) | 0,23 |
| Ausschüttungen | (0,39) | – | – | – | (0,35) | (0,11) |
| Schlussnettoinventarwert | 7,83 | 10,99 | 8,68 | 11,47 | 8,96 | 10,12 |
| Gesamtertrag | (13,91 %) | (13,94 %) | (14,82 %) | (13,50 %) | (13,41 %) | 2,30 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,39 % | 1,39 % | 2,39 % | 0,79 % | 0,78 % | 0,52 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,86 % | 2,84 % | 1,83 % | 3,45 % | 3,47 % | 3,69 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Responsible Asian Debt – Hard Currency (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD I4 US\$ | Thesaurierende Klasse USD M US\$ | Ausschüttende Klasse USD X (Monatlich) US\$ | Thesaurierende Klasse USD X US\$ | Thesaurierende Klasse USD Z US\$ |
|--|---|--|--|--|--|
| 31. Dezember 2023 | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,23 | 8,86 | 10,10 | 8,54 | 10,01 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,42 | 0,22 | 0,32 | 0,28 | 0,45 |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,27 | 0,24 | 0,26 | 0,23 | 0,26 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,69 | 0,46 | 0,58 | 0,51 | 0,71 |
| Ausschüttungen | – | – | (0,63) | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 10,92 | 9,32 | 10,05 | 9,05 | 10,72 |
| Gesamtertrag | 6,74 % | 5,19 % | 5,97 % | 5,97 % | 7,09 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,51 % | 1,97 % | 1,26 % | 1,26 % | 0,16 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,97 % | 2,48 % | 3,22 % | 3,22 % | 4,38 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,00 | 10,36 | 10,00 | 9,87 | 10,00 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,10 | 0,21 | 0,08 | 0,28 | 0,02 |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,13 | (1,71) | 0,13 | (1,61) | (0,01) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,23 | (1,50) | 0,21 | (1,33) | 0,01 |
| Ausschüttungen | – | – | (0,11) | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 10,23 | 8,86 | 10,10 | 8,54 | 10,01 |
| Gesamtertrag | 2,30 % | (14,48 %) | 2,10 % | (13,48 %) | 0,10 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,52 % | 1,99 % | 1,25 % | 1,00 % | 0,16 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,69 % | 2,25 % | 2,96 % | 3,24 % | 3,69 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt

| | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) AUD | Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich) CAD | Thesaurierende Klasse CHF A CHF | Ausschüttende Klasse CHF A CHF | Thesaurierende Klasse CHF I CHF | Ausschüttende Klasse CHF I CHF |
|---|---|---|---------------------------------------|--------------------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 7,91 | 8,21 | 9,23 | 6,80 | 9,64 | 6,82 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,24 | 0,25 | 0,27 | 0,20 | 0,33 | 0,23 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,22 | 0,29 | 0,04 | 0,02 | 0,04 | 0,02 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,46 | 0,54 | 0,31 | 0,22 | 0,37 | 0,25 |
| Ausschüttungen | (0,50) | (0,52) | – | (0,22) | – | (0,25) |
| Schlussnettoinventarwert | 7,87 | 8,23 | 9,54 | 6,80 | 10,01 | 6,82 |
| Gesamtertrag | 6,06 % | 6,84 % | 3,36 % | 3,32 % | 3,84 % | 3,84 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,06 % | 1,06 % | 1,02 % | 1,02 % | 0,55 % | 0,55 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,05 % | 3,11 % | 2,93 % | 2,94 % | 3,35 % | 3,41 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,04 | 9,33 | 10,23 | 7,79 | 10,63 | 7,82 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,27 | 0,28 | 0,30 | 0,22 | 0,35 | 0,25 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,01) | (1,00) | (1,30) | (0,97) | (1,34) | (0,97) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (0,74) | (0,72) | (1,00) | (0,75) | (0,99) | (0,72) |
| Ausschüttungen | (0,39) | (0,40) | – | (0,24) | – | (0,28) |
| Schlussnettoinventarwert | 7,91 | 8,21 | 9,23 | 6,80 | 9,64 | 6,82 |
| Gesamtertrag | (8,23 %) | (7,71 %) | (9,78 %) | (9,73 %) | (9,31 %) | (9,35 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,10 % | 1,12 % | 1,05 % | 1,05 % | 0,56 % | 0,56 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,29 % | 3,35 % | 3,11 % | 3,11 % | 3,59 % | 3,58 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse CHF I2 CHF | Ausschüttende Klasse CHF I2 CHF | Thesaurierende Klasse CHF I5 CHF | Thesaurierende Klasse CHF P CHF | Thesaurierende Klasse EUR A € | Ausschüttende Klasse EUR A € |
|---|--|---------------------------------------|--|---------------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,84 | 7,49 | 10,02 | 9,32 | 9,55 | 7,04 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,35 | 0,26 | 0,37 | 0,32 | 0,30 | 0,21 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,04 | 0,02 | 0,05 | 0,04 | 0,21 | 0,16 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,39 | 0,28 | 0,42 | 0,36 | 0,51 | 0,37 |
| Ausschüttungen | – | (0,28) | – | – | – | (0,23) |
| Schlussnettoinventarwert | 10,23 | 7,49 | 10,44 | 9,68 | 10,06 | 7,18 |
| Gesamtertrag | 3,96 % | 3,94 % | 4,19 % | 3,86 % | 5,34 % | 5,35 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,46 % | 0,44 % | 0,32 % | 0,53 % | 1,07 % | 1,07 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,48 % | 3,44 % | 3,64 % | 3,41 % | 3,07 % | 3,07 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,84 | 8,58 | 11,03 | 10,27 | 10,55 | 8,05 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,36 | 0,29 | 0,40 | 0,35 | 0,31 | 0,23 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,36) | (1,07) | (1,41) | (1,30) | (1,31) | (0,99) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,00) | (0,78) | (1,01) | (0,95) | (1,00) | (0,76) |
| Ausschüttungen | – | (0,31) | – | – | – | (0,25) |
| Schlussnettoinventarwert | 9,84 | 7,49 | 10,02 | 9,32 | 9,55 | 7,04 |
| Gesamtertrag | (9,23 %) | (9,17 %) | (9,16 %) | (9,25 %) | (9,48 %) | (9,51 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,47 % | 0,47 % | 0,32 % | 0,54 % | 1,06 % | 1,06 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,71 % | 3,69 % | 3,83 % | 3,62 % | 3,16 % | 3,16 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse EUR I € | Ausschüttende Klasse EUR I € | Thesaurierende Klasse EUR I2 € | Ausschüttende Klasse EUR I2 € | Thesaurierende Klasse EUR I5 € | Thesaurierende Klasse EUR M € |
|---|-------------------------------------|------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,98 | 7,05 | 10,06 | 7,63 | 10,43 | 9,33 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,36 | 0,25 | 0,37 | 0,28 | 0,40 | 0,23 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,22 | 0,14 | 0,22 | 0,15 | 0,24 | 0,20 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,58 | 0,39 | 0,59 | 0,43 | 0,64 | 0,43 |
| Ausschüttungen | – | (0,26) | – | (0,29) | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 10,56 | 7,18 | 10,65 | 7,77 | 11,07 | 9,76 |
| Gesamtertrag | 5,81 % | 5,72 % | 5,86 % | 5,82 % | 6,14 % | 4,61 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,58 % | 0,58 % | 0,48 % | 0,48 % | 0,33 % | 1,66 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,56 % | 3,56 % | 3,66 % | 3,66 % | 3,81 % | 2,48 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,97 | 8,05 | 11,05 | 8,72 | 11,44 | 10,36 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,38 | 0,27 | 0,38 | 0,28 | 0,42 | 0,25 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,37) | (0,98) | (1,37) | (1,05) | (1,43) | (1,28) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (0,99) | (0,71) | (0,99) | (0,77) | (1,01) | (1,03) |
| Ausschüttungen | – | (0,29) | – | (0,32) | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 9,98 | 7,05 | 10,06 | 7,63 | 10,43 | 9,33 |
| Gesamtertrag | (9,02 %) | (8,91 %) | (8,96 %) | (8,89 %) | (8,83 %) | (9,94 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,57 % | 0,57 % | 0,47 % | 0,47 % | 0,33 % | 1,65 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,66 % | 3,66 % | 3,74 % | 3,74 % | 3,92 % | 2,57 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

| | Ausschüttende Klasse EUR M € | Thesaurierende Klasse EUR P € | Thesaurierende Klasse EUR U € | Ausschüttende Klasse EUR X € | Thesaurierende Klasse GBP A £ | Thesaurierende Klasse GBP I £ |
|---|------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 6,79 | 9,56 | 9,49 | 8,80 | 10,00 | 10,30 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,17 | 0,34 | 0,32 | 0,32 | 0,31 | 0,37 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,13 | 0,22 | 0,20 | 0,18 | 0,38 | 0,39 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,30 | 0,56 | 0,52 | 0,50 | 0,69 | 0,76 |
| Ausschüttungen | (0,29) | – | – | (0,33) | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 6,80 | 10,12 | 10,01 | 8,97 | 10,69 | 11,06 |
| Gesamtertrag | 4,56 % | 5,86 % | 5,48 % | 5,92 % | 6,90 % | 7,38 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,65 % | 0,55 % | 0,82 % | 0,48 % | 1,06 % | 0,57 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,49 % | 3,54 % | 3,35 % | 3,66 % | 3,04 % | 3,52 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 7,89 | 10,51 | 10,45 | 10,06 | 10,87 | 11,14 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,18 | 0,36 | 0,33 | 0,34 | 0,34 | 0,40 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (0,95) | (1,31) | (1,29) | (1,23) | (1,21) | (1,24) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (0,77) | (0,95) | (0,96) | (0,89) | (0,87) | (0,84) |
| Ausschüttungen | (0,33) | – | – | (0,37) | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 6,79 | 9,56 | 9,49 | 8,80 | 10,00 | 10,30 |
| Gesamtertrag | (9,94 %) | (9,04 %) | (9,19 %) | (8,92 %) | (8,00 %) | (7,54 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,65 % | 0,55 % | 0,82 % | 0,47 % | 1,11 % | 0,59 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,57 % | 3,68 % | 3,41 % | 3,75 % | 3,29 % | 3,81 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

| | Ausschüttende Klasse GBP I £ | Thesaurierende Klasse GBP I2 £ | Ausschüttende Klasse GBP I2 £ | Ausschüttende Klasse GBP I5 £ | Thesaurierende Klasse GBP P £ | Thesaurierende Klasse JPY I ¥ |
|---|------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 8,30 | 10,29 | 8,15 | 7,66 | 9,67 | 1.024,16 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,29 | 0,38 | 0,30 | 0,29 | 0,35 | 37,46 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,31 | 0,39 | 0,29 | 0,27 | 0,37 | (16,00) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,60 | 0,77 | 0,59 | 0,56 | 0,72 | 21,46 |
| Ausschüttungen | (0,31) | – | (0,31) | (0,30) | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 8,59 | 11,06 | 8,43 | 7,92 | 10,39 | 1.045,62 |
| Gesamtertrag | 7,43 % | 7,48 % | 7,47 % | 7,59 % | 7,45 % | 2,10 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,57 % | 0,47 % | 0,47 % | 0,33 % | 0,56 % | 0,59 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,52 % | 3,63 % | 3,69 % | 3,79 % | 3,57 % | 3,66 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,34 | 11,12 | 9,17 | 8,62 | 10,45 | 1.126,55 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,33 | 0,41 | 0,33 | 0,32 | 0,37 | 39,33 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,03) | (1,24) | (1,01) | (0,95) | (1,15) | (141,72) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (0,70) | (0,83) | (0,68) | (0,63) | (0,78) | (102,39) |
| Ausschüttungen | (0,34) | – | (0,34) | (0,33) | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 8,30 | 10,29 | 8,15 | 7,66 | 9,67 | 1.024,16 |
| Gesamtertrag | (7,54 %) | (7,46 %) | (7,43 %) | (7,29 %) | (7,46 %) | (9,09 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,59 % | 0,49 % | 0,49 % | 0,34 % | 0,57 % | 0,58 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,81 % | 3,92 % | 3,90 % | 4,05 % | 3,80 % | 3,72 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

| | Ausschüttende Klasse JPY I ¥ | Thesaurierende Klasse SEK A SEK | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) SGD | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) US\$ | Thesaurierende Klasse USD A US\$ | Ausschüttende Klasse USD A US\$ |
|---|------------------------------------|---------------------------------------|---|--|--|---------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 719,95 | 93,27 | 16,13 | 8,19 | 11,29 | 8,11 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 25,73 | 2,82 | 0,49 | 0,25 | 0,36 | 0,26 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (11,28) | 2,26 | 0,43 | 0,33 | 0,49 | 0,33 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 14,45 | 5,08 | 0,92 | 0,58 | 0,85 | 0,59 |
| Ausschüttungen | (26,74) | – | (1,01) | (0,51) | – | (0,26) |
| Schlussnettoinventarwert | 707,66 | 98,35 | 16,04 | 8,26 | 12,14 | 8,44 |
| Gesamtertrag | 2,10 % | 5,45 % | 5,98 % | 7,45 % | 7,53 % | 7,51 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,59 % | 1,04 % | 1,07 % | 1,09 % | 1,09 % | 1,09 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,66 % | 2,98 % | 3,08 % | 3,14 % | 3,13 % | 3,14 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 824,34 | 102,60 | 18,32 | 9,29 | 12,21 | 9,07 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 28,93 | 3,21 | 0,52 | 0,27 | 0,37 | 0,27 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (103,03) | (12,54) | (1,92) | (0,97) | (1,29) | (0,95) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (74,10) | (9,33) | (1,40) | (0,70) | (0,92) | (0,68) |
| Ausschüttungen | (30,29) | – | (0,79) | (0,40) | – | (0,28) |
| Schlussnettoinventarwert | 719,95 | 93,27 | 16,13 | 8,19 | 11,29 | 8,11 |
| Gesamtertrag | (9,09 %) | (9,09 %) | (7,66 %) | (7,54 %) | (7,53 %) | (7,55 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,58 % | 1,11 % | 1,05 % | 1,08 % | 1,08 % | 1,08 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,70 % | 3,31 % | 3,12 % | 3,22 % | 3,22 % | 3,21 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD C1 US\$ | Ausschüttende Klasse USD C1 US\$ | Thesaurierende Klasse USD I US\$ | Ausschüttende Klasse USD I US\$ | Thesaurierende Klasse USD I2 US\$ | Ausschüttende Klasse USD I2 US\$ |
|---|---|--|--|---------------------------------------|---|--|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,72 | 8,57 | 11,79 | 8,62 | 11,58 | 8,61 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,21 | 0,18 | 0,44 | 0,32 | 0,44 | 0,33 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,42 | 0,36 | 0,51 | 0,35 | 0,50 | 0,35 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,63 | 0,54 | 0,95 | 0,67 | 0,94 | 0,68 |
| Ausschüttungen | – | (0,19) | – | (0,32) | – | (0,33) |
| Schlussnettoinventarwert | 10,35 | 8,92 | 12,74 | 8,97 | 12,52 | 8,96 |
| Gesamtertrag | 6,48 % | 6,46 % | 8,06 % | 8,04 % | 8,12 % | 8,15 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 2,09 % | 2,09 % | 0,59 % | 0,59 % | 0,49 % | 0,49 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,13 % | 2,13 % | 3,63 % | 3,64 % | 3,68 % | 3,78 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,62 | 9,58 | 12,69 | 9,64 | 12,45 | 9,63 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,22 | 0,19 | 0,44 | 0,33 | 0,44 | 0,34 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,12) | (1,00) | (1,34) | (1,01) | (1,31) | (1,01) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (0,90) | (0,81) | (0,90) | (0,68) | (0,87) | (0,67) |
| Ausschüttungen | – | (0,20) | – | (0,34) | – | (0,35) |
| Schlussnettoinventarwert | 9,72 | 8,57 | 11,79 | 8,62 | 11,58 | 8,61 |
| Gesamtertrag | (8,47 %) | (8,45 %) | (7,09 %) | (7,07 %) | (6,99 %) | (6,99 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 2,08 % | 2,08 % | 0,58 % | 0,58 % | 0,48 % | 0,48 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,22 % | 2,21 % | 3,72 % | 3,72 % | 3,82 % | 3,81 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD I5 US\$ | Ausschüttende Klasse USD I5 US\$ | Thesaurierende Klasse USD M US\$ | Ausschüttende Klasse USD M US\$ | Thesaurierende Klasse USD P US\$ | Thesaurierende Klasse USD Z US\$ |
|---|---|--|--|---------------------------------------|--|--|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 11,98 | 8,25 | 9,94 | 7,84 | 11,42 | 12,18 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,48 | 0,32 | 0,26 | 0,20 | 0,43 | 0,52 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,52 | 0,34 | 0,42 | 0,32 | 0,49 | 0,52 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1,00 | 0,66 | 0,68 | 0,52 | 0,92 | 1,04 |
| Ausschüttungen | – | (0,33) | – | (0,34) | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 12,98 | 8,58 | 10,62 | 8,02 | 12,34 | 13,22 |
| Gesamtertrag | 8,35 % | 8,25 % | 6,84 % | 6,84 % | 8,06 % | 8,54 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,34 % | 0,34 % | 1,69 % | 1,69 % | 0,56 % | 0,09 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,89 % | 3,89 % | 2,54 % | 2,53 % | 3,66 % | 4,14 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 12,86 | 9,23 | 10,82 | 8,92 | 12,29 | 13,04 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,48 | 0,33 | 0,26 | 0,21 | 0,43 | 0,52 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,36) | (0,96) | (1,14) | (0,93) | (1,30) | (1,38) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (0,88) | (0,63) | (0,88) | (0,72) | (0,87) | (0,86) |
| Ausschüttungen | – | (0,35) | – | (0,36) | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 11,98 | 8,25 | 9,94 | 7,84 | 11,42 | 12,18 |
| Gesamtertrag | (6,84 %) | (6,87 %) | (8,13 %) | (8,11 %) | (7,08 %) | (6,60 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,33 % | 0,33 % | 1,68 % | 1,68 % | 0,56 % | 0,08 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,97 % | 3,96 % | 2,61 % | 2,61 % | 3,74 % | 4,23 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement

| | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) AUD | Thesaurierende Klasse CHF A CHF | Thesaurierende Klasse CHF I CHF | Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) CNY | Thesaurierende Klasse EUR A € | Ausschüttende Klasse EUR A € |
|---|---|---------------------------------------|---------------------------------------|---|-------------------------------------|------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 7,08 | 10,75 | 11,64 | 84,25 | 11,29 | 6,76 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,34 | 0,51 | 0,62 | 4,16 | 0,57 | 0,33 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,18 | 0,01 | 0,02 | 0,83 | 0,21 | 0,13 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,52 | 0,52 | 0,64 | 4,99 | 0,78 | 0,46 |
| Ausschüttungen | (0,50) | – | – | (5,85) | – | (0,33) |
| Schlussnettoinventarwert | 7,10 | 11,27 | 12,28 | 83,39 | 12,07 | 6,89 |
| Gesamtertrag | 7,63 % | 4,84 % | 5,50 % | 6,21 % | 6,91 % | 6,99 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,30 % | 1,24 % | 0,69 % | 1,34 % | 1,31 % | 1,31 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,86 % | 4,65 % | 5,24 % | 5,02 % | 4,90 % | 4,88 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 7,96 | 11,58 | 12,47 | 94,05 | 12,13 | 7,61 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,34 | 0,49 | 0,60 | 4,15 | 0,52 | 0,32 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (0,80) | (1,32) | (1,43) | (7,92) | (1,36) | (0,85) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (0,46) | (0,83) | (0,83) | (3,77) | (0,84) | (0,53) |
| Ausschüttungen | (0,42) | – | – | (6,03) | – | (0,32) |
| Schlussnettoinventarwert | 7,08 | 10,75 | 11,64 | 84,25 | 11,29 | 6,76 |
| Gesamtertrag | (5,86 %) | (7,17 %) | (6,66 %) | (4,07 %) | (6,92 %) | (7,02 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,34 % | 1,27 % | 0,69 % | 1,36 % | 1,30 % | 1,30 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,71 % | 4,45 % | 5,03 % | 4,73 % | 4,51 % | 4,52 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse EUR I € | Thesaurierende Klasse EUR I2 € | Thesaurierende Klasse EUR M € | Ausschüttende Klasse EUR M € | Thesaurierende Klasse GBP I £ | Ausschüttende Klasse GBP I £ |
|---|-------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 12,03 | 11,15 | 10,01 | 6,83 | 13,18 | 7,53 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,68 | 0,65 | 0,44 | 0,29 | 0,72 | 0,42 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,23 | 0,21 | 0,19 | 0,13 | 0,50 | 0,26 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,91 | 0,86 | 0,63 | 0,42 | 1,22 | 0,68 |
| Ausschüttungen | – | – | – | (0,42) | – | (0,41) |
| Schlussnettoinventarwert | 12,94 | 12,01 | 10,64 | 6,83 | 14,40 | 7,80 |
| Gesamtertrag | 7,56 % | 7,71 % | 6,29 % | 6,39 % | 9,26 % | 9,38 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,72 % | 0,62 % | 1,89 % | 1,89 % | 0,70 % | 0,73 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,49 % | 5,62 % | 4,30 % | 4,30 % | 5,34 % | 5,54 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 12,85 | 11,90 | 10,82 | 7,85 | 13,86 | 8,37 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,63 | 0,62 | 0,41 | 0,28 | 0,71 | 0,43 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,45) | (1,37) | (1,22) | (0,86) | (1,39) | (0,85) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (0,82) | (0,75) | (0,81) | (0,58) | (0,68) | (0,42) |
| Ausschüttungen | – | – | – | (0,44) | – | (0,42) |
| Schlussnettoinventarwert | 12,03 | 11,15 | 10,01 | 6,83 | 13,18 | 7,53 |
| Gesamtertrag | (6,38 %) | (6,30 %) | (7,49 %) | (7,54 %) | (4,91 %) | (5,06 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,71 % | 0,61 % | 1,89 % | 1,89 % | 0,73 % | 0,74 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,10 % | 5,27 % | 3,92 % | 3,93 % | 5,31 % | 5,25 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse GBP I2 | Ausschüttende Klasse GBP I2 | Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) | Thesaurierende Klasse JPY I | Ausschüttende Klasse JPY I | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) |
|---|---------------------------------|--------------------------------|--|--------------------------------|-------------------------------|--|
| | £ | £ | HKD | ¥ | ¥ | SGD |
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 12,24 | 7,34 | 9,97 | 1.205,68 | 1.014,69 | 14,86 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,71 | 0,41 | 0,49 | 68,62 | 56,03 | 0,73 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,43 | 0,26 | 0,30 | (23,35) | (19,43) | 0,37 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1,14 | 0,67 | 0,79 | 45,27 | 36,60 | 1,10 |
| Ausschüttungen | – | (0,41) | (0,70) | – | (52,62) | (1,04) |
| Schlussnettoinventarwert | 13,38 | 7,60 | 10,06 | 1.250,95 | 998,67 | 14,92 |
| Gesamtertrag | 9,31 % | 9,44 % | 8,25 % | 3,75 % | 3,78 % | 7,74 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,62 % | 0,62 % | 1,33 % | 0,74 % | 0,74 % | 1,31 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,56 % | 5,54 % | 4,97 % | 5,62 % | 5,63 % | 4,93 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 12,86 | 8,15 | 10,00 | 1.288,30 | 1.000,00 | 16,57 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,67 | 0,42 | 0,13 | 64,55 | 10,05 | 0,69 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,29) | (0,82) | (0,04) | (147,17) | 4,64 | (1,52) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (0,62) | (0,40) | 0,09 | (82,62) | 14,69 | (0,83) |
| Ausschüttungen | – | (0,41) | (0,12) | – | – | (0,88) |
| Schlussnettoinventarwert | 12,24 | 7,34 | 9,97 | 1.205,68 | 1.014,69 | 14,86 |
| Gesamtertrag | (4,82 %) | (4,88 %) | 0,93 % | (6,41 %) | 1,47 % | (5,08 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,63 % | 0,63 % | 1,29 % | 0,72 % | 0,66 % | 1,28 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,41 % | 5,36 % | 4,66 % | 5,20 % | 4,93 % | 4,49 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

| | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) US\$ | Thesaurierende Klasse USD A US\$ | Ausschüttende Klasse USD A US\$ | Thesaurierende Klasse USD C1 US\$ | Thesaurierende Klasse USD I US\$ | Ausschüttende Klasse USD I US\$ |
|--|--|--|---------------------------------------|---|--|---------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 7,57 | 13,11 | 7,91 | 10,26 | 14,00 | 8,09 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,38 | 0,68 | 0,40 | 0,42 | 0,82 | 0,46 |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,29 | 0,54 | 0,31 | 0,42 | 0,57 | 0,31 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,67 | 1,22 | 0,71 | 0,84 | 1,39 | 0,77 |
| Ausschüttungen | (0,53) | – | (0,39) | – | – | (0,44) |
| Schlussnettoinventarwert | 7,71 | 14,33 | 8,23 | 11,10 | 15,39 | 8,42 |
| Gesamtertrag | 9,25 % | 9,31 % | 9,25 % | 8,19 % | 9,93 % | 9,94 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,33 % | 1,33 % | 1,33 % | 2,33 % | 0,73 % | 0,74 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,00 % | 4,99 % | 4,99 % | 3,98 % | 5,59 % | 5,65 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 8,41 | 13,77 | 8,70 | 10,89 | 14,61 | 8,87 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,36 | 0,61 | 0,37 | 0,37 | 0,73 | 0,43 |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (0,75) | (1,27) | (0,79) | (1,00) | (1,34) | (0,80) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (0,39) | (0,66) | (0,42) | (0,63) | (0,61) | (0,37) |
| Ausschüttungen | (0,45) | – | (0,37) | – | – | (0,41) |
| Schlussnettoinventarwert | 7,57 | 13,11 | 7,91 | 10,26 | 14,00 | 8,09 |
| Gesamtertrag | (4,73 %) | (4,79 %) | (4,83 %) | (5,79 %) | (4,18 %) | (4,15 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,32 % | 1,32 % | 1,32 % | 2,32 % | 0,71 % | 0,72 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,58 % | 4,59 % | 4,60 % | 3,60 % | 5,20 % | 5,08 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD I2 US\$ | Ausschüttende Klasse USD I2 US\$ | Thesaurierende Klasse USD I4* US\$ | Thesaurierende Klasse USD I5 US\$ | Thesaurierende Klasse USD M US\$ | Ausschüttende Klasse USD M US\$ |
|---|---|--|--|---|--|---------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 13,11 | 7,90 | 10,00 | 10,04 | 10,55 | 8,00 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,75 | 0,45 | 0,39 | 0,62 | 0,47 | 0,35 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,58 | 0,31 | 0,27 | 0,41 | 0,44 | 0,31 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1,33 | 0,76 | 0,66 | 1,03 | 0,91 | 0,66 |
| Ausschüttungen | – | (0,44) | – | – | – | (0,49) |
| Schlussnettoinventarwert | 14,44 | 8,22 | 10,66 | 11,07 | 11,46 | 8,17 |
| Gesamtertrag | 10,14 % | 10,02 % | 6,60 % | 10,26 % | 8,63 % | 8,68 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,62 % | 0,62 % | 0,51 % | 0,43 % | 1,93 % | 1,93 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,57 % | 5,63 % | 5,95 % | 5,90 % | 4,34 % | 4,35 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 13,68 | 8,69 | – | 10,00 | 11,15 | 8,97 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,70 | 0,43 | – | 0,17 | 0,43 | 0,34 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,27) | (0,79) | – | (0,13) | (1,03) | (0,82) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (0,57) | (0,36) | – | 0,04 | (0,60) | (0,48) |
| Ausschüttungen | – | (0,43) | – | – | – | (0,49) |
| Schlussnettoinventarwert | 13,11 | 7,90 | – | 10,04 | 10,55 | 8,00 |
| Gesamtertrag | (4,17 %) | (4,15 %) | – | 0,40 % | (5,38 %) | (5,37 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,62 % | 0,62 % | – | 0,40 % | 1,91 % | 1,91 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,30 % | 5,30 % | – | 5,60 % | 4,02 % | 4,03 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD Z US\$ |
|---|--|
| 31. Dezember 2023 | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 12,64 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,81 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,53 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1,34 |
| Schlussnettoinventarwert | 13,98 |
| Gesamtertrag | 10,60 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,13 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 6,17 % |
| 31. Dezember 2022 | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 13,12 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,74 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,22) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (0,48) |
| Schlussnettoinventarwert | 12,64 |
| Gesamtertrag | (3,66 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,12 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,80 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Strategic Income

| | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) AUD | Ausschüttende Klasse AUD Z (Monatlich) AUD | Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)* CNY | Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) € | Thesaurierende Klasse EUR A € | Thesaurierende Klasse EUR I € |
|---|---|---|--|---|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 8,10 | 8,74 | 100,00 | 7,56 | 10,05 | 10,68 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,24 | 0,34 | 1,69 | 0,22 | 0,31 | 0,38 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,26 | 0,29 | 2,12 | 0,21 | 0,28 | 0,31 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,50 | 0,63 | 3,81 | 0,43 | 0,59 | 0,69 |
| Ausschüttungen | (0,53) | (0,57) | (3,75) | (0,49) | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 8,07 | 8,80 | 100,06 | 7,50 | 10,64 | 11,37 |
| Gesamtertrag | 6,42 % | 7,55 % | 4,01 % | 5,95 % | 5,87 % | 6,46 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,08 % | 0,12 % | 1,15 % | 1,10 % | 1,10 % | 0,61 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,00 % | 3,96 % | 2,98 % | 3,04 % | 3,03 % | 3,52 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,56 | 10,22 | – | 9,04 | 10,00 | 12,18 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,22 | 0,34 | – | 0,20 | 0,04 | 0,34 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,31) | (1,43) | – | (1,33) | 0,01 | (1,84) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,09) | (1,09) | – | (1,13) | 0,05 | (1,50) |
| Ausschüttungen | (0,37) | (0,39) | – | (0,35) | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 8,10 | 8,74 | – | 7,56 | 10,05 | 10,68 |
| Gesamtertrag | (11,58 %) | (10,76 %) | – | (12,73 %) | 0,50 % | (12,32 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,15 % | 0,13 % | – | 1,10 % | 1,16 % | 0,61 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,56 % | 3,79 % | – | 2,46 % | 2,93 % | 3,01 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Strategic Income (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse EUR M | Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse GBP I (Monatlich)* | Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) | Thesaurierende Klasse JPY I | Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert) |
|---|--------------------------------|--|---|--|--------------------------------|---|
| | € | £ | £ | HKD | ¥ | ¥ |
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,85 | 7,95 | 10,00 | 8,31 | 1.065,57 | 1.656,82 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,24 | 0,24 | 0,02 | 0,25 | 38,46 | 65,42 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,28 | 0,34 | 0,21 | 0,33 | (11,97) | 204,70 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,52 | 0,58 | 0,23 | 0,58 | 26,49 | 270,12 |
| Ausschüttungen | – | (0,52) | – | (0,54) | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 10,37 | 8,01 | 10,23 | 8,35 | 1.092,06 | 1.926,94 |
| Gesamtertrag | 5,28 % | 7,61 % | 2,30 % | 7,28 % | 2,49 % | 16,30 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,68 % | 1,10 % | 0,67 % | 1,12 % | 0,62 % | 0,62 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,40 % | 3,07 % | 3,14 % | 3,12 % | 3,60 % | 3,59 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 11,36 | 9,36 | – | 9,76 | 1.216,93 | 1.610,18 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,19 | 0,22 | – | 0,22 | 33,92 | 52,06 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,70) | (1,27) | – | (1,29) | (185,28) | (5,42) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,51) | (1,05) | – | (1,07) | (151,36) | 46,64 |
| Ausschüttungen | – | (0,36) | – | (0,38) | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 9,85 | 7,95 | – | 8,31 | 1.065,57 | 1.656,82 |
| Gesamtertrag | (13,29 %) | (11,37 %) | – | (11,15 %) | (12,44 %) | 2,90 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,69 % | 1,15 % | – | 1,12 % | 0,62 % | 0,62 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 1,84 % | 2,53 % | – | 2,44 % | 2,98 % | 3,06 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Strategic Income (Fortsetzung)

| | Ausschüttende Klasse JPY I CG ¥ | Ausschüttende Klasse JPY I ¥ | Thesaurierende Klasse JPY Z ¥ | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) SGD | Thesaurierende Klasse SGD A SGD | Ausschüttende Klasse SGD I (Monatlich) SGD |
|---|---------------------------------------|------------------------------------|-------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 875,62 | 803,30 | 915,43 | 15,90 | 20,36 | 17,69 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 31,29 | 29,82 | 37,50 | 0,47 | 0,63 | 0,61 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (9,53) | (9,88) | (10,05) | 0,56 | 0,74 | 0,62 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 21,76 | 19,94 | 27,45 | 1,03 | 1,37 | 1,23 |
| Ausschüttungen | – | (24,35) | – | (1,03) | – | (1,15) |
| Schlussnettoinventarwert | 897,38 | 798,89 | 942,88 | 15,90 | 21,73 | 17,77 |
| Gesamtertrag | 2,49 % | 2,56 % | 3,00 % | 6,79 % | 6,73 % | 7,27 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,62 % | 0,65 % | 0,12 % | 1,11 % | 1,11 % | 0,61 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,56 % | 3,68 % | 4,06 % | 3,02 % | 3,02 % | 3,51 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 1.001,03 | 944,76 | 1.000,00 | 18,64 | 22,86 | 20,62 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 28,06 | 26,03 | 25,82 | 0,41 | 0,51 | 0,56 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (152,44) | (142,34) | (110,39) | (2,43) | (3,01) | (2,69) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (124,38) | (116,31) | (84,57) | (2,02) | (2,50) | (2,13) |
| Ausschüttungen | (1,03) | (25,15) | – | (0,72) | – | (0,80) |
| Schlussnettoinventarwert | 875,62 | 803,30 | 915,43 | 15,90 | 20,36 | 17,69 |
| Gesamtertrag | (12,44 %) | (12,44 %) | (8,46 %) | (10,99 %) | (10,94 %) | (10,48 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,62 % | 0,62 % | 0,12 % | 1,09 % | 1,09 % | 0,61 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,03 % | 3,02 % | 3,63 % | 2,44 % | 2,40 % | 3,03 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Strategic Income (Fortsetzung)

| | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) US\$ | Thesaurierende Klasse USD A US\$ | Ausschüttende Klasse USD A US\$ | Thesaurierende Klasse USD C1 US\$ | Thesaurierende Klasse USD I US\$ | Ausschüttende Klasse USD I US\$ |
|---|--|--|---------------------------------------|---|--|---------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 8,11 | 11,37 | 9,39 | 9,99 | 12,27 | 9,43 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,25 | 0,36 | 0,29 | 0,21 | 0,45 | 0,34 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,40 | 0,58 | 0,47 | 0,51 | 0,64 | 0,48 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,65 | 0,94 | 0,76 | 0,72 | 1,09 | 0,82 |
| Ausschüttungen | (0,53) | – | (0,27) | – | – | (0,32) |
| Schlussnettoinventarwert | 8,23 | 12,31 | 9,88 | 10,71 | 13,36 | 9,93 |
| Gesamtertrag | 8,34 % | 8,27 % | 8,24 % | 7,21 % | 8,88 % | 8,87 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,12 % | 1,12 % | 1,12 % | 2,12 % | 0,62 % | 0,62 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,09 % | 3,08 % | 3,09 % | 2,07 % | 3,58 % | 3,59 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,47 | 12,72 | 10,75 | 11,29 | 13,67 | 10,80 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,22 | 0,30 | 0,25 | 0,16 | 0,39 | 0,30 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,22) | (1,65) | (1,38) | (1,46) | (1,79) | (1,39) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,00) | (1,35) | (1,13) | (1,30) | (1,40) | (1,09) |
| Ausschüttungen | (0,36) | – | (0,23) | – | – | (0,28) |
| Schlussnettoinventarwert | 8,11 | 11,37 | 9,39 | 9,99 | 12,27 | 9,43 |
| Gesamtertrag | (10,63 %) | (10,61 %) | (10,62 %) | (11,51 %) | (10,24 %) | (10,19 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,12 % | 1,12 % | 1,12 % | 2,12 % | 0,62 % | 0,62 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,51 % | 2,56 % | 2,56 % | 1,49 % | 3,05 % | 3,07 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Strategic Income (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD M US\$ | Ausschüttende Klasse USD M US\$ | Thesaurierende Klasse USD Z US\$ |
|---|--|---------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 11,36 | 8,30 | 12,39 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,29 | 0,21 | 0,52 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,58 | 0,40 | 0,64 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,87 | 0,61 | 1,16 |
| Ausschüttungen | – | (0,37) | – |
| Schlussnettoinventarwert | 12,23 | 8,54 | 13,55 |
| Gesamtertrag | 7,66 % | 7,64 % | 9,36 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen
Nettovermögen**

| | | | |
|--------------------------------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,72 % | 1,72 % | 0,12 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,48 % | 2,48 % | 4,07 % |

31. Dezember 2022

| | | | |
|---|-----------|-----------|----------|
| Eröffnungsnettoinventarwert | 12,79 | 9,69 | 13,72 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,23 | 0,17 | 0,45 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,66) | (1,24) | (1,78) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,43) | (1,07) | (1,33) |
| Ausschüttungen | – | (0,32) | – |
| Schlussnettoinventarwert | 11,36 | 8,30 | 12,39 |
| Gesamtertrag | (11,18 %) | (11,16 %) | (9,69 %) |

**Verhältnis zum durchschnittlichen
Nettovermögen**

| | | | |
|--------------------------------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,72 % | 1,72 % | 0,12 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 1,95 % | 1,96 % | 3,55 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Sustainable Asia High Yield

| | Thesaurierende Klasse EUR X € | Thesaurierende Klasse GBP X £ | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) US\$ | Thesaurierende Klasse USD A US\$ | Thesaurierende Klasse USD I US\$ | Thesaurierende Klasse USD Z US\$ |
|---|-------------------------------------|-------------------------------------|--|--|--|--|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 8,51 | 9,31 | 7,63 | 8,28 | 8,34 | 8,70 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,46 | 0,48 | 0,27 | 0,34 | 0,39 | 0,46 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (0,45) | (0,32) | (0,17) | (0,22) | (0,22) | (0,23) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,01 | 0,16 | 0,10 | 0,12 | 0,17 | 0,23 |
| Ausschüttungen | – | – | (0,66) | – | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 8,52 | 9,47 | 7,07 | 8,40 | 8,51 | 8,93 |
| Gesamtertrag | 0,12 % | 1,72 % | 1,47 % | 1,45 % | 2,04 % | 2,64 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,56 % | 0,57 % | 1,42 % | 1,41 % | 0,82 % | 0,22 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,34 % | 5,15 % | 3,75 % | 4,09 % | 4,68 % | 5,28 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,00 | 10,00 | 9,90 | 9,90 | 9,90 | 10,00 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,38 | 0,32 | 0,33 | 0,34 | 0,40 | 0,41 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,87) | (1,01) | (1,99) | (1,96) | (1,96) | (1,71) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,49) | (0,69) | (1,66) | (1,62) | (1,56) | (1,30) |
| Ausschüttungen | – | – | (0,61) | – | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 8,51 | 9,31 | 7,63 | 8,28 | 8,34 | 8,70 |
| Gesamtertrag | (14,90 %) | (6,90 %) | (16,64 %) | (16,36 %) | (15,76 %) | (13,43 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,54 % | 0,54 % | 1,40 % | 1,40 % | 0,80 % | 0,21 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,41 % | 5,16 % | 4,17 % | 4,18 % | 4,82 % | 4,93 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Sustainable Asia High Yield (Fortsetzung)

| | Ausschüttende Klasse USD Z US\$ |
|--|---------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,42 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,48 |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (0,25) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,23 |
| Ausschüttungen | (0,52) |
| Schlussnettoinventarwert | 9,13 |
| Gesamtertrag | 2,56 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,22 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,29 % |
| 31. Dezember 2022 | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,00 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,39 |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (0,70) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (0,31) |
| Ausschüttungen | (0,27) |
| Schlussnettoinventarwert | 9,42 |
| Gesamtertrag | (2,84 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,19 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,54 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Corporate Debt

| | Thesaurierende Klasse CHF I CHF | Thesaurierende Klasse EUR A € | Thesaurierende Klasse EUR I € | Thesaurierende Klasse EUR I3 € | Thesaurierende Klasse EUR M € | Ausschüttende Klasse EUR M € |
|---|---------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,96 | 9,94 | 11,42 | 9,75 | 9,51 | 6,66 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,44 | 0,34 | 0,48 | 0,44 | 0,25 | 0,17 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (0,03) | 0,13 | 0,17 | 0,14 | 0,12 | 0,07 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,41 | 0,47 | 0,65 | 0,58 | 0,37 | 0,24 |
| Ausschüttungen | – | – | – | – | – | (0,34) |
| Schlussnettoinventarwert | 11,37 | 10,41 | 12,07 | 10,33 | 9,88 | 6,56 |
| Gesamtertrag | 3,74 % | 4,73 % | 5,69 % | 5,95 % | 3,89 % | 3,81 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,95 % | 1,78 % | 0,99 % | 0,68 % | 2,56 % | 2,56 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,95 % | 3,36 % | 4,14 % | 4,44 % | 2,57 % | 2,57 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 12,78 | 11,64 | 13,27 | 11,29 | 11,23 | 8,30 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,47 | 0,36 | 0,49 | 0,45 | 0,26 | 0,18 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (2,29) | (2,06) | (2,34) | (1,99) | (1,98) | (1,43) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,82) | (1,70) | (1,85) | (1,54) | (1,72) | (1,25) |
| Ausschüttungen | – | – | – | – | – | (0,39) |
| Schlussnettoinventarwert | 10,96 | 9,94 | 11,42 | 9,75 | 9,51 | 6,66 |
| Gesamtertrag | (14,24 %) | (14,60 %) | (13,94 %) | (13,64 %) | (15,32 %) | (15,23 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,99 % | 1,79 % | 1,00 % | 0,69 % | 2,58 % | 2,58 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,05 % | 3,18 % | 4,14 % | 4,44 % | 2,56 % | 2,56 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Corporate Debt (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse EUR X € | Thesaurierende Klasse GBP I £ | Thesaurierende Klasse SEK A SEK | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) US\$ | Thesaurierende Klasse USD A US\$ | Thesaurierende Klasse USD C1 US\$ |
|---|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|--|--|---|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,36 | 12,35 | 87,48 | 7,32 | 12,24 | 9,32 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,48 | 0,52 | 2,88 | 0,25 | 0,43 | 0,23 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,15 | 0,38 | 1,46 | 0,24 | 0,43 | 0,33 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,63 | 0,90 | 4,34 | 0,49 | 0,86 | 0,56 |
| Ausschüttungen | – | – | – | (0,41) | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 10,99 | 13,25 | 91,82 | 7,40 | 13,10 | 9,88 |
| Gesamtertrag | 6,08 % | 7,29 % | 4,96 % | 6,95 % | 7,03 % | 6,01 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,58 % | 0,99 % | 1,73 % | 1,81 % | 1,81 % | 2,82 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,54 % | 4,11 % | 3,26 % | 3,42 % | 3,42 % | 2,42 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 11,99 | 14,13 | 102,06 | 8,81 | 14,03 | 10,80 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,49 | 0,57 | 3,21 | 0,27 | 0,43 | 0,23 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (2,12) | (2,35) | (17,79) | (1,37) | (2,22) | (1,71) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,63) | (1,78) | (14,58) | (1,10) | (1,79) | (1,48) |
| Ausschüttungen | – | – | – | (0,39) | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 10,36 | 12,35 | 87,48 | 7,32 | 12,24 | 9,32 |
| Gesamtertrag | (13,59 %) | (12,60 %) | (14,29 %) | (12,64 %) | (12,76 %) | (13,70 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,59 % | 1,04 % | 1,87 % | 1,82 % | 1,82 % | 2,82 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,55 % | 4,14 % | 3,49 % | 3,31 % | 3,41 % | 2,38 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Corporate Debt (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD I US\$ | Ausschüttende Klasse USD I US\$ | Thesaurierende Klasse USD I2 US\$ | Thesaurierende Klasse USD M US\$ | Ausschüttende Klasse USD M US\$ |
|---|--|---------------------------------------|---|--|---------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 13,20 | 8,77 | 11,93 | 9,38 | 7,19 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,57 | 0,37 | 0,53 | 0,25 | 0,19 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,47 | 0,30 | 0,43 | 0,32 | 0,23 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1,04 | 0,67 | 0,96 | 0,57 | 0,42 |
| Ausschüttungen | – | (0,37) | – | – | (0,37) |
| Schlussnettoinventarwert | 14,24 | 9,07 | 12,89 | 9,95 | 7,24 |
| Gesamtertrag | 7,88 % | 7,90 % | 8,05 % | 6,08 % | 6,16 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,01 % | 1,02 % | 0,85 % | 2,60 % | 2,62 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,23 % | 4,23 % | 4,37 % | 2,60 % | 2,62 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 15,01 | 10,41 | 13,54 | 10,83 | 8,76 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,57 | 0,38 | 0,53 | 0,25 | 0,20 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (2,38) | (1,63) | (2,14) | (1,70) | (1,36) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,81) | (1,25) | (1,61) | (1,45) | (1,16) |
| Ausschüttungen | – | (0,39) | – | – | (0,41) |
| Schlussnettoinventarwert | 13,20 | 8,77 | 11,93 | 9,38 | 7,19 |
| Gesamtertrag | (12,06 %) | (12,07 %) | (11,89 %) | (13,39 %) | (13,41 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,02 % | 1,02 % | 0,86 % | 2,62 % | 2,62 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,20 % | 4,22 % | 4,39 % | 2,61 % | 2,60 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Debt- Hard Currency²

| | Thesaurierende Klasse EUR I3 € | Thesaurierende Klasse EUR I4* € | Thesaurierende Klasse EUR X € | Thesaurierende Klasse USD I US\$ | Thesaurierende Klasse USD I5 US\$ |
|--|--------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|--|---|
| 31. Dezember 2023 | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,79 | 10,00 | 8,36 | 8,54 | 8,55 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,49 | 0,33 | 0,39 | 0,39 | 0,42 |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,67 | 0,50 | 0,52 | 0,73 | 0,74 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1,16 | 0,83 | 0,91 | 1,12 | 1,16 |
| Schlussnettoinventarwert | 11,95 | 10,83 | 9,27 | 9,66 | 9,71 |
| Gesamtertrag | 10,75 % | 8,30 % | 10,89 % | 13,11 % | 13,57 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,59 % | 0,51 % | 0,45 % | 0,79 % | 0,47 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,42 % | 4,55 % | 4,55 % | 4,35 % | 4,67 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,00 | – | 10,00 | 10,00 | 10,00 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,12 | – | 0,36 | 0,34 | 0,36 |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,67 | – | (2,00) | (1,80) | (1,81) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,79 | – | (1,64) | (1,46) | (1,45) |
| Schlussnettoinventarwert | 10,79 | – | 8,36 | 8,54 | 8,55 |
| Gesamtertrag | 7,90 % | – | (16,40 %) | (14,60 %) | (14,50 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,61 % | – | 0,45 % | 0,89 % | 0,53 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,22 % | – | 4,46 % | 4,13 % | 4,61 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Tactical Macro¹

| | Thesaurierende Klasse USD I* US\$ | Thesaurierende Klasse USD I5* US\$ | Thesaurierende Klasse USD Z* US\$ |
|---|---|--|---|
| 31. Dezember 2023 | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,00 | 10,00 | 10,00 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,01 | 0,10 | 0,06 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,21 | 0,14 | 0,20 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,22 | 0,24 | 0,26 |
| Schlussnettoinventarwert | 10,22 | 10,24 | 10,26 |
| Gesamtertrag | 2,20 % | 2,40 % | 2,60 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,97 % | 0,70 % | 0,18 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,31 % | 2,02 % | 1,13 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Ultra Short Term Euro Bond

| | Thesaurierende Klasse CHF P CHF | Thesaurierende Klasse CHF U CHF | Thesaurierende Klasse EUR A € | Thesaurierende Klasse EUR I € | Ausschüttende Klasse EUR I € | Thesaurierende Klasse EUR I2 € |
|---|---------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|--------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsinventarwert | 97,48 | 96,91 | 94,09 | 99,21 | 95,44 | 98,02 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 2,13 | 2,01 | 2,03 | 2,28 | 2,23 | 2,30 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 2,43 | 2,42 | 4,10 | 4,39 | 4,09 | 4,33 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 4,56 | 4,43 | 6,13 | 6,67 | 6,32 | 6,63 |
| Ausschüttungen | – | – | – | – | (1,91) | – |
| Schlussinventarwert | 102,04 | 101,34 | 100,22 | 105,88 | 99,85 | 104,65 |
| Gesamtertrag | 4,68 % | 4,57 % | 6,52 % | 6,72 % | 6,71 % | 6,76 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,26 % | 0,37 % | 0,48 % | 0,28 % | 0,28 % | 0,24 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,14 % | 2,03 % | 2,09 % | 2,24 % | 2,30 % | 2,28 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsinventarwert | 100,00 | 102,92 | 99,83 | 105,08 | 102,73 | 103,78 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 1,20 | 1,71 | 1,46 | 1,80 | 1,82 | 1,80 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (3,72) | (7,72) | (7,20) | (7,67) | (7,54) | (7,56) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (2,52) | (6,01) | (5,74) | (5,87) | (5,72) | (5,76) |
| Ausschüttungen | – | – | – | – | (1,57) | – |
| Schlussinventarwert | 97,48 | 96,91 | 94,09 | 99,21 | 95,44 | 98,02 |
| Gesamtertrag | (2,52 %) | (5,84 %) | (5,75 %) | (5,59 %) | (5,58 %) | (5,55 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,28 % | 0,37 % | 0,47 % | 0,28 % | 0,28 % | 0,24 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,09 % | 1,73 % | 1,51 % | 1,78 % | 1,87 % | 1,80 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Ultra Short Term Euro Bond (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse EUR 15 € | Thesaurierende Klasse EUR M € | Thesaurierende Klasse EUR U € | Thesaurierende Klasse EUR Z € | Thesaurierende Klasse USD I US\$ | Thesaurierende Klasse USD Z US\$ |
|---|--------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|--|--|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 99,56 | 93,22 | 97,51 | 100,17 | 96,33 | 107,40 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 2,39 | 1,93 | 2,17 | 2,48 | 2,22 | 2,73 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 4,41 | 3,83 | 4,28 | 4,46 | 6,38 | 7,07 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 6,80 | 5,76 | 6,45 | 6,94 | 8,60 | 9,80 |
| Schlussnettoinventarwert | 106,36 | 98,98 | 103,96 | 107,11 | 104,93 | 117,20 |
| Gesamtertrag | 6,83 % | 6,18 % | 6,61 % | 6,93 % | 8,93 % | 9,12 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,18 % | 0,68 % | 0,39 % | 0,09 % | 0,29 % | 0,10 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,33 % | 1,99 % | 2,16 % | 2,41 % | 2,23 % | 2,45 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 105,34 | 99,50 | 103,38 | 105,86 | 99,95 | 111,22 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 1,90 | 1,16 | 1,61 | 1,79 | 1,71 | 2,22 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (7,68) | (7,44) | (7,48) | (7,48) | (5,33) | (6,04) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (5,78) | (6,28) | (5,87) | (5,69) | (3,62) | (3,82) |
| Schlussnettoinventarwert | 99,56 | 93,22 | 97,51 | 100,17 | 96,33 | 107,40 |
| Gesamtertrag | (5,49 %) | (6,31 %) | (5,68 %) | (5,38 %) | (3,62 %) | (3,43 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,18 % | 1,07 % | 0,37 % | 0,08 % | 0,28 % | 0,09 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 1,88 % | 1,23 % | 1,60 % | 1,74 % | 1,78 % | 2,06 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies

| | Thesaurierende Klasse CHF I CHF | Thesaurierende Klasse EUR A € | Thesaurierende Klasse EUR I € | Thesaurierende Klasse EUR I2 € | Thesaurierende Klasse EUR M € | Thesaurierende Klasse EUR P € |
|---|---------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,34 | 10,07 | 10,51 | 10,85 | 9,83 | 9,85 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,06) | (0,14) | (0,07) | (0,05) | (0,20) | (0,07) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,21) | (0,99) | (1,04) | (1,08) | (0,97) | (0,95) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,27) | (1,13) | (1,11) | (1,13) | (1,17) | (1,02) |
| Schlussnettoinventarwert | 9,07 | 8,94 | 9,40 | 9,72 | 8,66 | 8,83 |
| Gesamtertrag | (12,28 %) | (11,22 %) | (10,56 %) | (10,41 %) | (11,90 %) | (10,36 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,78 % | 2,60 % | 1,81 % | 1,73 % | 3,40 % | 1,74 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,62 %) | (1,44 %) | (0,69 %) | (0,51 %) | (2,19 %) | (0,72 %) |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,72 | 9,52 | 9,86 | 10,16 | 9,37 | 10,00 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,40) | (0,45) | (0,43) | (0,38) | (0,41) | (0,07) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 1,02 | 1,00 | 1,08 | 1,07 | 0,87 | (0,08) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,62 | 0,55 | 0,65 | 0,69 | 0,46 | (0,15) |
| Schlussnettoinventarwert | 10,34 | 10,07 | 10,51 | 10,85 | 9,83 | 9,85 |
| Gesamtertrag | 6,38 % | 5,78 % | 6,59 % | 6,79 % | 4,91 % | (1,50 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 4,09 % | 4,66 % | 4,22 % | 4,81 % | 4,67 % | 2,02 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (3,87 %) | (4,47 %) | (4,08 %) | (3,56 %) | (4,23 %) | (1,39 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse GBP I £ | Thesaurierende Klasse GBP I2 £ | Ausschüttende Klasse GBP I2 £ | Thesaurierende Klasse GBP I5 £ | Thesaurierende Klasse GBP P £ | Thesaurierende Klasse GBP Z £ |
|---|-------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 11,52 | 11,56 | 9,96 | 11,74 | 11,16 | 12,02 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,08) | (0,05) | (0,03) | (0,04) | (0,06) | 0,02 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (0,97) | (0,99) | (0,86) | (0,98) | (0,95) | (1,03) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,05) | (1,04) | (0,89) | (1,02) | (1,01) | (1,01) |
| Schlussnettoinventarwert | 10,47 | 10,52 | 9,07 | 10,72 | 10,15 | 11,01 |
| Gesamtertrag | (9,11 %) | (9,00 %) | (8,94 %) | (8,69 %) | (9,05 %) | (8,40 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,87 % | 1,72 % | 1,73 % | 1,46 % | 1,81 % | 1,14 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,71 %) | (0,48 %) | (0,35 %) | (0,34 %) | (0,59 %) | 0,15 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,61 | 10,63 | 10,00 | 10,77 | 10,27 | 10,98 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,40) | (0,41) | 0,03 | (0,35) | (0,41) | (0,36) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 1,31 | 1,34 | (0,07) | 1,32 | 1,30 | 1,40 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,91 | 0,93 | (0,04) | 0,97 | 0,89 | 1,04 |
| Schlussnettoinventarwert | 11,52 | 11,56 | 9,96 | 11,74 | 11,16 | 12,02 |
| Gesamtertrag | 8,58 % | 8,75 % | (0,40 %) | 9,01 % | 8,67 % | 9,47 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 3,89 % | 3,89 % | 0,19 % | 3,39 % | 4,02 % | 3,32 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (3,58 %) | (3,62 %) | 0,76 % | (3,05 %) | (3,71 %) | (3,06 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse JPY I ¥ | Thesaurierende Klasse SGD A** SGD | Thesaurierende Klasse USD A US\$ | Thesaurierende Klasse USD C1 US\$ | Thesaurierende Klasse USD I US\$ | Thesaurierende Klasse USD I2 US\$ |
|---|-------------------------------------|---|--|---|--|---|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 1.029,89 | 19,98 | 11,03 | 10,57 | 11,97 | 12,01 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (5,93) | 1,25 | (0,14) | (0,23) | (0,07) | (0,05) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (136,10) | (1,88) | (0,91) | (0,88) | (0,99) | (0,99) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (142,03) | (0,63) | (1,05) | (1,11) | (1,06) | (1,04) |
| Schlussnettoinventarwert | 887,86 | 19,35 | 9,98 | 9,46 | 10,91 | 10,97 |
| Gesamtertrag | (13,79 %) | (3,25 %)** | (9,52 %) | (10,50 %) | (8,86 %) | (8,66 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,94 % | 44,14 % | 2,67 % | 3,67 % | 1,93 % | 1,77 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,63 %) | 8,84 % | (1,40 %) | (2,39 %) | (0,62 %) | (0,47 %) |

**Wiederaufnahme der Geschäfte am Dienstag, 13. April 2023.

*** Die Gesamterträge für den Zeitraum von 1. Januar 2023 bis 5. April 2023 betrug (6,97 %).

31. Dezember 2022

| | | | | | | |
|---|----------|----------|----------|----------|----------|----------|
| Eröffnungsnettoinventarwert | 1.000,00 | 20,00 | 10,26 | 9,92 | 11,05 | 11,07 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (11,88) | 0,00 | (0,39) | (0,58) | (0,40) | (0,44) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 41,77 | 0,11 | 1,16 | 1,23 | 1,32 | 1,38 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 29,89 | 0,11 | 0,77 | 0,65 | 0,92 | 0,94 |
| Schlussnettoinventarwert | 1.029,89 | 20,11 | 11,03 | 10,57 | 11,97 | 12,01 |
| Gesamtertrag | 2,99 % | 0,55 % | 7,50 % | 6,55 % | 8,33 % | 8,49 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 2,08 % | 2,22 % | 4,02 % | 5,76 % | 3,69 % | 3,97 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (1,53 %) | (0,57 %) | (3,62 %) | (5,52 %) | (3,36 %) | (3,73 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD I5 US\$ | Thesaurierende Klasse USD M US\$ | Thesaurierende Klasse USD P US\$ | Thesaurierende Klasse USD Z US\$ |
|---|---|--|--|--|
| 31. Dezember 2023 | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 12,22 | 10,89 | 11,66 | 12,32 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,03) | (0,23) | (0,08) | 0,01 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,01) | (0,89) | (0,96) | (1,02) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,04) | (1,12) | (1,04) | (1,01) |
| Schlussnettoinventarwert | 11,18 | 9,77 | 10,62 | 11,31 |
| Gesamtertrag | (8,51 %) | (10,28 %) | (8,92 %) | (8,20 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,52 % | 3,47 % | 1,82 % | 1,15 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,23 %) | (2,22 %) | (0,69 %) | 0,09 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 11,24 | 10,21 | 10,76 | 11,28 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,36) | (0,52) | (0,29) | (0,25) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 1,34 | 1,20 | 1,19 | 1,29 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,98 | 0,68 | 0,90 | 1,04 |
| Schlussnettoinventarwert | 12,22 | 10,89 | 11,66 | 12,32 |
| Gesamtertrag | 8,72 % | 6,66 % | 8,36 % | 9,22 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 3,28 % | 5,14 % | 3,03 % | 2,47 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (2,97 %) | (4,80 %) | (2,53 %) | (2,04 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Equity

| | Thesaurierende Klasse JPY I3 ¥ | Thesaurierende Klasse USD A US\$ | Thesaurierende Klasse USD I US\$ | Ausschüttende Klasse USD I US\$ | Thesaurierende Klasse USD M US\$ |
|---|--------------------------------------|--|--|---------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 816,04 | 13,76 | 20,34 | 20,18 | 7,74 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,97 | (0,14) | (0,03) | (0,03) | (0,15) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 241,05 | 5,07 | 7,52 | 7,47 | 2,84 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 242,02 | 4,93 | 7,49 | 7,44 | 2,69 |
| Schlussnettoinventarwert | 1.058,06 | 18,69 | 27,83 | 27,62 | 10,43 |
| Gesamtertrag | 29,66 % | 35,83 % | 36,82 % | 36,87 % | 34,75 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen
Nettovermögen**

| | | | | | |
|--------------------------------|--------|----------|----------|----------|----------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,74 % | 1,72 % | 0,97 % | 0,97 % | 2,54 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,10 % | (0,87 %) | (0,12 %) | (0,12 %) | (1,63 %) |

31. Dezember 2022

| | | | | | |
|---|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| Eröffnungsnettoinventarwert | 1.000,00 | 18,74 | 27,49 | 27,28 | 10,00 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 1,47 | (0,12) | (0,02) | (0,02) | (0,12) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (185,43) | (4,86) | (7,13) | (7,08) | (2,14) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (183,96) | (4,98) | (7,15) | (7,10) | (2,26) |
| Schlussnettoinventarwert | 816,04 | 13,76 | 20,34 | 20,18 | 7,74 |
| Gesamtertrag | (18,40 %) | (26,57 %) | (26,01 %) | (26,03 %) | (22,60 %) |

**Verhältnis zum durchschnittlichen
Nettovermögen**

| | | | | | |
|--------------------------------|--------|----------|----------|----------|----------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,73 % | 1,72 % | 0,97 % | 0,97 % | 2,52 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,21 % | (0,81 %) | (0,08 %) | (0,10 %) | (1,58 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Equity Index PutWrite

| | Thesaurierende Klasse EUR I € | Ausschüttende Klasse EUR I3 € | Thesaurierende Klasse EUR I4 € | Ausschüttende Klasse EUR I4* € | Thesaurierende Klasse EUR M € | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) £ |
|---|-------------------------------------|-------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 11,69 | 8,83 | 11,65 | 10,00 | 10,76 | 13,58 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,10 | 0,05 | 0,07 | 0,01 | (0,11) | 0,04 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 1,40 | 1,10 | 1,46 | 0,06 | 1,33 | 1,17 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1,50 | 1,15 | 1,53 | 0,07 | 1,22 | 1,21 |
| Ausschüttungen | – | (0,03) | – | – | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 13,19 | 9,95 | 13,18 | 10,07 | 11,98 | 14,79 |
| Gesamtertrag | 12,83 % | 13,03 % | 13,13 % | 0,70 % | 11,34 % | 8,91 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,72 % | 0,52 % | 0,46 % | 0,46 % | 2,07 % | 0,69 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,76 % | 0,56 % | 0,58 % | 1,92 % | (0,98 %) | 0,27 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 13,45 | 10,38 | 13,37 | – | 12,56 | 13,50 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,00 | 0,02 | 0,03 | – | (0,16) | 0,00 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,76) | (1,35) | (1,75) | – | (1,64) | 0,08 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,76) | (1,33) | (1,72) | – | (1,80) | 0,08 |
| Ausschüttungen | – | (0,22) | – | – | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 11,69 | 8,83 | 11,65 | – | 10,76 | 13,58 |
| Gesamtertrag | (13,09 %) | (12,93 %) | (12,86 %) | – | (14,33 %) | 0,59 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,70 % | 0,52 % | 0,46 % | – | 2,08 % | 0,73 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,00 | 0,17 % | 0,24 % | – | (1,38 %) | 0,00 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Equity Index PutWrite (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse GBP I3 | Ausschüttende Klasse GBP I3 | Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)* | Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) | Ausschüttende Klasse GBP I4* | Ausschüttende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) |
|--|---------------------------------|--------------------------------|--|---|---------------------------------|--|
| | £ | £ | £ | £ | £ | £ |
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 11,58 | 9,40 | 10,00 | 14,05 | 10,00 | 10,06 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,07 | 0,06 | 0,05 | 0,09 | 0,01 | 0,04 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,98 | 1,33 | 0,45 | 1,19 | 0,23 | 0,84 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1,05 | 1,39 | 0,50 | 1,28 | 0,24 | 0,88 |
| Ausschüttungen | – | (0,03) | (0,02) | – | – | (0,41) |
| Schlussnettoinventarwert | 12,63 | 10,76 | 10,48 | 15,33 | 10,24 | 10,53 |
| Gesamtertrag | 9,07 % | 14,82 % | 5,00 % | 9,11 % | 2,40 % | 8,96 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,52 % | 0,52 % | 0,51 % | 0,46 % | 0,49 % | 0,66 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,61 % | 0,58 % | 0,94 % | 0,59 % | 1,61 % | 0,38 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 11,49 | 10,90 | – | 13,93 | – | 10,40 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,02 | 0,02 | – | 0,03 | – | 0,00 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,07 | (1,29) | – | 0,09 | – | 0,07 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,09 | (1,27) | – | 0,12 | – | 0,07 |
| Ausschüttungen | – | (0,23) | – | – | – | (0,41) |
| Schlussnettoinventarwert | 11,58 | 9,40 | – | 14,05 | – | 10,06 |
| Gesamtertrag | 0,78 % | (11,73 %) | – | 0,86 % | – | 0,64 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,54 % | 0,54 % | – | 0,48 % | – | 0,70 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,19 % | 0,17 % | – | 0,24 % | – | 0,03 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Equity Index PutWrite (Fortsetzung)

| | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) SGD | Thesaurierende Klasse USD A US\$ | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) US\$ | Thesaurierende Klasse USD I US\$ | Ausschüttende Klasse USD I3 US\$ | Thesaurierende Klasse USD I4 US\$ |
|---|---|--|--|--|--|---|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 18,85 | 13,06 | 10,55 | 13,71 | 9,09 | 13,29 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,04) | (0,03) | 0,02 | 0,06 | 0,06 | 0,09 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 2,46 | 1,95 | 1,57 | 2,05 | 1,35 | 1,99 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 2,42 | 1,92 | 1,59 | 2,11 | 1,41 | 2,08 |
| Ausschüttungen | (0,89) | – | (0,50) | – | (0,03) | – |
| Schlussnettoinventarwert | 20,38 | 14,98 | 11,64 | 15,82 | 10,47 | 15,37 |
| Gesamtertrag | 13,13 % | 14,70 % | 15,43 % | 15,39 % | 15,53 % | 15,65 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,29 % | 1,31 % | 0,70 % | 0,71 % | 0,53 % | 0,47 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,23 %) | (0,19 %) | 0,16 % | 0,41 % | 0,60 % | 0,65 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 22,21 | 14,70 | 12,29 | 15,34 | 10,39 | 14,84 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,12) | (0,08) | 0,00 | 0,00 | 0,02 | 0,03 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (2,44) | (1,56) | (1,30) | (1,63) | (1,10) | (1,58) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (2,56) | (1,64) | (1,30) | (1,63) | (1,08) | (1,55) |
| Ausschüttungen | (0,80) | – | (0,44) | – | (0,22) | – |
| Schlussnettoinventarwert | 18,85 | 13,06 | 10,55 | 13,71 | 9,09 | 13,29 |
| Gesamtertrag | (11,67 %) | (11,16 %) | (10,66 %) | (10,63 %) | (10,45 %) | (10,44 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,27 % | 1,31 % | 0,71 % | 0,71 % | 0,53 % | 0,47 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,59 %) | (0,60 %) | (0,01 %) | 0,00 % | 0,17 % | 0,25 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Equity Index PutWrite (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD M US\$ | Thesaurierende Klasse USD Z US\$ |
|---|--|--|
| 31. Dezember 2023 | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 12,32 | 13,87 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,14) | 0,16 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 1,84 | 2,07 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1,70 | 2,23 |
| Schlussnettoinventarwert | 14,02 | 16,10 |
| Gesamtertrag | 13,80 % | 16,08 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 2,12 % | 0,11 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (1,03 %) | 1,04 % |
| 31. Dezember 2022 | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 13,98 | 15,43 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,18) | 0,08 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,48) | (1,64) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,66) | (1,56) |
| Schlussnettoinventarwert | 12,32 | 13,87 |
| Gesamtertrag | (11,87 %) | (10,11 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 2,11 % | 0,11 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (1,40 %) | 0,59 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Large Cap Value

| | Thesaurierende Klasse EUR A | Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) | Thesaurierende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | Ausschüttende Klasse EUR 14 (nicht währungsgesichert) | Thesaurierende Klasse EUR 15 (nicht währungsgesichert) |
|---|--------------------------------|---|--------------------------------|---|--|---|
| | € | € | € | € | € | € |
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,87 | 10,68 | 9,20 | 9,42 | 9,91 | 10,42 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,06 | 0,06 | 0,12 | 0,13 | 0,15 | 0,17 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (0,68) | (0,78) | (0,57) | (0,69) | (0,70) | (0,75) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (0,62) | (0,72) | (0,45) | (0,56) | (0,55) | (0,58) |
| Ausschüttungen | – | – | – | – | (0,10) | – |
| Schlussnettoinventarwert | 10,25 | 9,96 | 8,75 | 8,86 | 9,26 | 9,84 |
| Gesamtertrag | (5,70 %) | (6,74 %) | (4,89 %) | (5,94 %) | (5,62 %) | (5,57 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,56 % | 1,55 % | 0,78 % | 0,78 % | 0,50 % | 0,43 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,62 % | 0,60 % | 1,40 % | 1,42 % | 1,64 % | 1,71 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,00 | 10,00 | 10,00 | 10,00 | 10,00 | 10,00 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,01 | 0,02 | 0,08 | 0,07 | 0,10 | 0,14 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,86 | 0,66 | (0,88) | (0,65) | (0,19) | 0,28 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,87 | 0,68 | (0,80) | (0,58) | (0,09) | 0,42 |
| Schlussnettoinventarwert | 10,87 | 10,68 | 9,20 | 9,42 | 9,91 | 10,42 |
| Gesamtertrag | 8,70 % | 6,80 % | (8,00 %) | (5,80 %) | (0,90 %) | 4,20 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,62 % | 1,57 % | 0,76 % | 0,75 % | 0,48 % | 0,43 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,38 % | 0,33 % | 1,19 % | 1,12 % | 1,33 % | 1,44 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Large Cap Value (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse GBP I | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | Ausschüttende Klasse GBP I | Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) |
|---|--------------------------------|---|-------------------------------|--|--|---|
| | £ | £ | £ | £ | £ | £ |
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,76 | 9,66 | 9,76 | 9,66 | 10,92 | 10,28 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,13 | 0,13 | 0,13 | 0,13 | 0,17 | 0,13 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (0,46) | (0,91) | (0,46) | (0,92) | (1,02) | (0,97) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (0,33) | (0,78) | (0,33) | (0,79) | (0,85) | (0,84) |
| Ausschüttungen | – | – | (0,01) | (0,01) | (0,11) | – |
| Schlussnettoinventarwert | 9,43 | 8,88 | 9,42 | 8,86 | 9,96 | 9,44 |
| Gesamtertrag | (3,38 %) | (8,07 %) | (3,39 %) | (8,20 %) | (7,87 %) | (8,17 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,76 % | 0,79 % | 0,79 % | 0,78 % | 0,50 % | 0,75 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 1,37 % | 1,43 % | 1,41 % | 1,41 % | 1,64 % | 1,40 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,00 | 10,00 | 10,00 | 10,00 | 10,00 | 10,00 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,01 | 0,01 | 0,01 | 0,01 | 0,12 | 0,07 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (0,25) | (0,35) | (0,25) | (0,35) | 0,80 | 0,21 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (0,24) | (0,34) | (0,24) | (0,34) | 0,92 | 0,28 |
| Schlussnettoinventarwert | 9,76 | 9,66 | 9,76 | 9,66 | 10,92 | 10,28 |
| Gesamtertrag | (2,40 %) | (3,40 %) | (2,40 %) | (3,40 %) | 9,20 % | 2,80 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,86 % | 0,87 % | 0,86 % | 0,87 % | 0,50 % | 0,77 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,94 % | 0,94 % | 0,94 % | 0,94 % | 1,39 % | 1,22 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Large Cap Value (Fortsetzung)

| | Ausschüttende Klasse GBP P | Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert) | Ausschüttende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert) | Thesaurierende Klasse USD A | Thesaurierende Klasse USD I | Ausschüttende Klasse USD I4 |
|---|-------------------------------|---|--|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| | £ | £ | £ | US\$ | US\$ | US\$ |
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,63 | 10,48 | 10,29 | 9,50 | 10,28 | 9,63 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,14 | 0,14 | 0,14 | 0,06 | 0,14 | 0,16 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (0,50) | (0,99) | (0,96) | (0,38) | (0,41) | (0,38) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (0,36) | (0,85) | (0,82) | (0,32) | (0,27) | (0,22) |
| Ausschüttungen | (0,02) | – | (0,04) | – | – | (0,10) |
| Schlussnettoinventarwert | 10,25 | 9,63 | 9,43 | 9,18 | 10,01 | 9,31 |
| Gesamtertrag | (3,37 %) | (8,11 %) | (8,02 %) | (3,37 %) | (2,63 %) | (2,34 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,73 % | 0,71 % | 0,71 % | 1,59 % | 0,79 % | 0,51 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 1,41 % | 1,44 % | 1,51 % | 0,60 % | 1,40 % | 1,67 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,00 | 10,00 | 10,00 | 10,00 | 10,39 | 10,00 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,02 | 0,08 | 0,04 | 0,03 | 0,11 | 0,10 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,61 | 0,40 | 0,25 | (0,53) | (0,22) | (0,47) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,63 | 0,48 | 0,29 | (0,50) | (0,11) | (0,37) |
| Schlussnettoinventarwert | 10,63 | 10,48 | 10,29 | 9,50 | 10,28 | 9,63 |
| Gesamtertrag | 6,30 % | 4,80 % | 2,90 % | (5,00 %) | (1,06 %) | (3,70 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,78 % | 0,71 % | 0,72 % | 1,59 % | 0,80 % | 0,50 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 1,16 % | 1,37 % | 1,18 % | 0,39 % | 1,16 % | 1,40 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Large Cap Value (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD I5 US\$ | Thesaurierende Klasse USD M US\$ | Thesaurierende Klasse USD Y+ US\$ | Thesaurierende Klasse USD Z US\$ |
|---|---|--|---|--|
| 31. Dezember 2023 | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 9,65 | 9,35 | 10,00 | 10,10 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,16 | (0,02) | 0,06 | 0,21 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (0,38) | (0,38) | (0,17) | (0,41) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (0,22) | (0,40) | (0,11) | (0,20) |
| Schlussnettoinventarwert | 9,43 | 8,95 | 9,89 | 9,90 |
| Gesamtertrag | (2,28 %) | (4,28 %) | (1,10 %) | (1,98 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,44 % | 2,39 % | 0,75 % | 0,08 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 1,74 % | (0,21 %) | 1,54 % | 2,11 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,00 | 10,00 | – | 10,00 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,13 | (0,03) | – | 0,11 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (0,48) | (0,62) | – | (0,01) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (0,35) | (0,65) | – | 0,10 |
| Schlussnettoinventarwert | 9,65 | 9,35 | – | 10,10 |
| Gesamtertrag | (3,50 %) | (6,50 %) | – | 1,00 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,44 % | 2,40 % | – | 0,09 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 1,56 % | (0,42 %) | – | 1,85 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Long Short Equity

| | Thesaurierende Klasse EUR A € | Thesaurierende Klasse EUR I € | Thesaurierende Klasse EUR I3 € | Thesaurierende Klasse EUR M € | Ausschüttende Klasse GBP I3 £ | Thesaurierende Klasse SGD A1 SGD |
|---|-------------------------------------|-------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,40 | 11,22 | 10,54 | 10,21 | 10,08 | 24,13 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,08) | 0,02 | 0,06 | (0,16) | 0,06 | (0,08) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 1,12 | 1,22 | 1,15 | 1,09 | 1,27 | 2,81 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1,04 | 1,24 | 1,21 | 0,93 | 1,33 | 2,73 |
| Ausschüttungen | – | – | – | – | (0,07) | – |
| Schlussnettoinventarwert | 11,44 | 12,46 | 11,75 | 11,14 | 11,34 | 26,86 |
| Gesamtertrag | 10,00 % | 11,05 % | 11,48 % | 9,11 % | 13,23 % | 11,31 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen
Nettovermögen**

| | | | | | | |
|--------------------------------|----------|--------|--------|----------|--------|----------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 2,40 % | 1,50 % | 1,13 % | 3,19 % | 1,15 % | 2,03 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,71 %) | 0,19 % | 0,56 % | (1,50 %) | 0,54 % | (0,32 %) |

31. Dezember 2022

| | | | | | | |
|---|-----------|-----------|----------|-----------|----------|----------|
| Eröffnungsnettoinventarwert | 11,66 | 12,47 | 11,67 | 11,53 | 10,98 | 26,43 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,12) | (0,03) | 0,01 | (0,20) | 0,01 | (0,22) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,14) | (1,22) | (1,14) | (1,12) | (0,91) | (2,08) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,26) | (1,25) | (1,13) | (1,32) | (0,90) | (2,30) |
| Schlussnettoinventarwert | 10,40 | 11,22 | 10,54 | 10,21 | 10,08 | 24,13 |
| Gesamtertrag | (10,81 %) | (10,02 %) | (9,68 %) | (11,45 %) | (8,20 %) | (8,70 %) |

**Verhältnis zum durchschnittlichen
Nettovermögen**

| | | | | | | |
|--------------------------------|----------|----------|--------|----------|--------|----------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 2,41 % | 1,51 % | 1,11 % | 3,19 % | 1,17 % | 2,13 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (1,13 %) | (0,24 %) | 0,11 % | (1,90 %) | 0,05 % | (0,88 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Long Short Equity (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD A (PF) US\$ | Thesaurierende Klasse USD A US\$ | Thesaurierende Klasse USD A1 US\$ | Ausschüttende Klasse USD I (PF) US\$ | Thesaurierende Klasse USD I US\$ | Thesaurierende Klasse USD I3 US\$ |
|---|---|--|---|---|--|---|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 11,72 | 11,86 | 12,63 | 12,33 | 13,49 | 10,99 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,08) | (0,09) | (0,04) | (0,04) | 0,03 | 0,07 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 1,52 | 1,56 | 1,65 | 1,62 | 1,77 | 1,45 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1,44 | 1,47 | 1,61 | 1,58 | 1,80 | 1,52 |
| Ausschüttungen | – | – | – | (0,08) | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 13,16 | 13,33 | 14,24 | 13,83 | 15,29 | 12,51 |
| Gesamtertrag | 12,29 % | 12,39 % | 12,75 % | 12,83 % | 13,34 % | 13,83 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 2,38 % | 2,46 % | 2,06 % | 2,02 % | 1,56 % | 1,15 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,65 %) | (0,73 %) | (0,33 %) | (0,29 %) | 0,18 % | 0,59 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 12,74 | 12,97 | 13,77 | 13,31 | 14,61 | 11,85 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,06) | (0,14) | (0,11) | 0,02 | (0,02) | 0,01 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (0,96) | (0,97) | (1,03) | (1,00) | (1,10) | (0,87) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,02) | (1,11) | (1,14) | (0,98) | (1,12) | (0,86) |
| Schlussnettoinventarwert | 11,72 | 11,86 | 12,63 | 12,33 | 13,49 | 10,99 |
| Gesamtertrag | (8,01 %) | (8,56 %) | (8,28 %) | (7,36 %) | (7,67 %) | (7,26 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,89 % | 2,44 % | 2,19 % | 1,18 % | 1,53 % | 1,11 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,54 %) | (1,11 %) | (0,86 %) | 0,16 % | (0,14 %) | 0,11 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Long Short Equity (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD M US\$ | Thesaurierende Klasse USD U US\$ | Thesaurierende Klasse USD Z US\$ |
|---|--|--|--|
| 31. Dezember 2023 | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,98 | 12,39 | 14,90 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,18) | (0,03) | 0,24 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 1,44 | 1,63 | 1,99 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1,26 | 1,60 | 2,23 |
| Schlussnettoinventarwert | 12,24 | 13,99 | 17,13 |
| Gesamtertrag | 11,48 % | 12,91 % | 14,97 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 3,26 % | 2,00 % | 0,21 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (1,54 %) | (0,23 %) | 1,52 % |
| 31. Dezember 2022 | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 12,11 | 13,49 | 15,93 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,21) | (0,08) | 0,17 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (0,92) | (1,02) | (1,20) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,13) | (1,10) | (1,03) |
| Schlussnettoinventarwert | 10,98 | 12,39 | 14,90 |
| Gesamtertrag | (9,33 %) | (8,15 %) | (6,47 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 3,23 % | 1,98 % | 0,19 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (1,89 %) | (0,65 %) | 1,10 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities

| | Thesaurierende Klasse AUD E AUD | Thesaurierende Klasse AUD T AUD | Thesaurierende Klasse EUR I3 € | Thesaurierende Klasse EUR M € | Thesaurierende Klasse EUR1 A € | Thesaurierende Klasse EUR1 I € |
|---|---------------------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 16,18 | 15,19 | 22,53 | 15,91 | 25,08 | 27,36 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,35) | (0,17) | 0,04 | (0,33) | (0,26) | (0,05) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 2,50 | 2,36 | 3,49 | 2,42 | 3,85 | 4,22 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 2,15 | 2,19 | 3,53 | 2,09 | 3,59 | 4,17 |
| Schlussnettoinventarwert | 18,33 | 17,38 | 26,06 | 18,00 | 28,67 | 31,53 |
| Gesamtertrag | 13,29 % | 14,42 % | 15,67 % | 13,14 % | 14,31 % | 15,24 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 2,92 % | 1,94 % | 0,68 % | 2,84 % | 1,86 % | 1,02 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (2,06 %) | (1,08 %) | 0,18 % | (1,98 %) | (0,99 %) | (0,16 %) |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 20,43 | 18,99 | 28,01 | 20,22 | 31,56 | 34,13 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,36) | (0,17) | 0,06 | (0,33) | (0,25) | (0,03) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (3,89) | (3,63) | (5,54) | (3,98) | (6,23) | (6,74) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (4,25) | (3,80) | (5,48) | (4,31) | (6,48) | (6,77) |
| Schlussnettoinventarwert | 16,18 | 15,19 | 22,53 | 15,91 | 25,08 | 27,36 |
| Gesamtertrag | (20,80 %) | (20,01 %) | (19,56 %) | (21,32 %) | (20,53 %) | (19,84 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 3,01 % | 1,99 % | 0,64 % | 2,81 % | 1,82 % | 0,98 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (2,09 %) | (1,07 %) | 0,24 % | (1,93 %) | (0,94 %) | (0,11 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

| | Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert) £ | Thesaurierende Klasse SGD A SGD | Thesaurierende Klasse USD B US\$ | Thesaurierende Klasse USD C1 US\$ | Thesaurierende Klasse USD C2 US\$ | Thesaurierende Klasse USD E US\$ |
|--|---|---------------------------------------|--|---|---|--|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 16,38 | 42,26 | 17,80 | 13,62 | 17,80 | 16,75 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,03 | (0,44) | (0,40) | (0,29) | (0,40) | (0,38) |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 1,89 | 6,89 | 3,21 | 2,46 | 3,22 | 3,03 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1,92 | 6,45 | 2,81 | 2,17 | 2,82 | 2,65 |
| Ausschüttungen | (0,04) | – | – | – | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 18,26 | 48,71 | 20,61 | 15,79 | 20,62 | 19,40 |
| Gesamtertrag | 11,77 % | 15,26 % | 15,79 % | 15,93 % | 15,84 % | 15,82 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,67 % | 1,86 % | 3,00 % | 2,90 % | 2,99 % | 3,00 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,20 % | (0,99 %) | (2,10 %) | (2,01 %) | (2,15 %) | (2,11 %) |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 17,50 | 51,87 | 21,90 | 16,74 | 21,89 | 20,60 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,04 | (0,41) | (0,38) | (0,28) | (0,38) | (0,36) |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,14) | (9,20) | (3,72) | (2,84) | (3,71) | (3,49) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,10) | (9,61) | (4,10) | (3,12) | (4,09) | (3,85) |
| Ausschüttungen | (0,02) | – | – | – | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 16,38 | 42,26 | 17,80 | 13,62 | 17,80 | 16,75 |
| Gesamtertrag | (6,27 %) | (18,53 %) | (18,72 %) | (18,64 %) | (18,68 %) | (18,69 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,66 % | 1,80 % | 2,95 % | 2,85 % | 2,95 % | 2,95 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,22 % | (0,93 %) | (2,06 %) | (1,96 %) | (2,06 %) | (2,05 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD I2* US\$ | Thesaurierende Klasse USD I3 US\$ | Ausschüttende Klasse USD I3 US\$ | Thesaurierende Klasse USD M US\$ | Thesaurierende Klasse USD T US\$ | Thesaurierende Klasse USD U US\$ |
|--|--|---|--|--|--|--|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,00 | 26,14 | 23,44 | 18,95 | 19,51 | 26,82 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,01 | 0,05 | 0,05 | (0,41) | (0,23) | (0,16) |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 1,19 | 4,78 | 4,28 | 3,43 | 3,53 | 4,88 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1,20 | 4,83 | 4,33 | 3,02 | 3,30 | 4,72 |
| Ausschüttungen | – | – | (0,06) | – | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | 11,20 | 30,97 | 27,71 | 21,97 | 22,81 | 31,54 |
| Gesamtertrag | 12,00 % | 18,48 % | 18,52 % | 15,94 % | 16,91 % | 17,60 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,85 % | 0,70 % | 0,70 % | 2,90 % | 2,00 % | 1,45 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,10 % | 0,17 % | 0,19 % | (2,02 %) | (1,11 %) | (0,56 %) |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | – | 31,41 | 28,22 | 23,28 | 23,75 | 32,48 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | – | 0,06 | 0,06 | (0,40) | (0,21) | (0,14) |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | – | (5,33) | (4,80) | (3,93) | (4,03) | (5,52) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | – | (5,27) | (4,74) | (4,33) | (4,24) | (5,66) |
| Ausschüttungen | – | – | (0,04) | – | – | – |
| Schlussnettoinventarwert | – | 26,14 | 23,44 | 18,95 | 19,51 | 26,82 |
| Gesamtertrag | – | (16,78 %) | (16,82 %) | (18,60 %) | (17,85 %) | (17,43 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | – | 0,65 % | 0,65 % | 2,85 % | 1,95 % | 1,40 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | – | 0,23 % | 0,24 % | (2,00 %) | (1,05 %) | (0,51 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD Z US\$ | Thesaurierende Klasse USD1 A US\$ | Thesaurierende Klasse USD1 I US\$ | Ausschüttende Klasse USD1 I US\$ | Thesaurierende Klasse ZAR B ZAR | Thesaurierende Klasse ZAR C2 ZAR |
|---|--|---|---|--|---------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 22,06 | 29,24 | 32,71 | 31,57 | 258,68 | 257,19 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,16 | (0,32) | (0,06) | (0,05) | (5,83) | (5,89) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 4,05 | 5,31 | 5,98 | 5,75 | 54,07 | 53,98 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 4,21 | 4,99 | 5,92 | 5,70 | 48,24 | 48,09 |
| Schlussnettoinventarwert | 26,27 | 34,23 | 38,63 | 37,27 | 306,92 | 305,28 |
| Gesamtertrag | 19,08 % | 17,07 % | 18,10 % | 18,06 % | 18,65 % | 18,70 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,20 % | 1,90 % | 1,05 % | 1,05 % | 2,97 % | 2,97 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,69 % | (1,02 %) | (0,17 %) | (0,14 %) | (2,09 %) | (2,14 %) |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 26,38 | 35,57 | 39,46 | 38,08 | 310,31 | 308,51 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,17 | (0,29) | (0,04) | (0,04) | (5,76) | (5,81) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (4,49) | (6,04) | (6,71) | (6,47) | (45,87) | (45,51) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (4,32) | (6,33) | (6,75) | (6,51) | (51,63) | (51,32) |
| Schlussnettoinventarwert | 22,06 | 29,24 | 32,71 | 31,57 | 258,68 | 257,19 |
| Gesamtertrag | (16,38 %) | (17,80 %) | (17,11 %) | (17,10 %) | (16,64 %) | (16,63 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,15 % | 1,85 % | 1,00 % | 1,00 % | 3,06 % | 3,06 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,75 % | (0,96 %) | (0,12 %) | (0,12 %) | (2,14 %) | (2,13 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse ZAR E ZAR | Thesaurierende Klasse ZAR T ZAR |
|---|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 238,22 | 283,17 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (5,39) | (3,40) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 49,81 | 59,57 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 44,42 | 56,17 |
| Schlussnettoinventarwert | 282,64 | 339,34 |
| Gesamtertrag | 18,65 % | 19,84 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 2,96 % | 1,98 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (2,10 %) | (1,11 %) |
| 31. Dezember 2022 | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 285,76 | 336,29 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (5,27) | (3,19) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (42,27) | (49,93) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (47,54) | (53,12) |
| Schlussnettoinventarwert | 238,22 | 283,17 |
| Gesamtertrag | (16,64 %) | (15,80 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 3,06 % | 2,03 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (2,13 %) | (1,09 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities

| | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) AUD | Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) AUD | Thesaurierende Klasse AUD B AUD | Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) AUD | Thesaurierende Klasse AUD E AUD | Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) AUD |
|---|---|---|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 8,13 | 7,53 | 11,22 | 7,52 | 12,14 | 8,74 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,09 | (0,01) | (0,01) | (0,01) | (0,03) | 0,08 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,46 | 0,42 | 0,65 | 0,42 | 0,72 | 0,49 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,55 | 0,41 | 0,64 | 0,41 | 0,69 | 0,57 |
| Ausschüttungen | (0,32) | (0,30) | – | (0,30) | – | (0,35) |
| Schlussnettoinventarwert | 8,36 | 7,64 | 11,86 | 7,63 | 12,83 | 8,96 |
| Gesamtertrag | 7,12 % | 5,69 % | 5,70 % | 5,70 % | 5,68 % | 6,79 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,68 % | 2,94 % | 2,94 % | 2,94 % | 2,96 % | 1,95 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 1,12 % | (0,17 %) | (0,12 %) | (0,10 %) | (0,28 %) | 0,89 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 12,16 | 11,41 | 16,33 | 11,40 | 17,67 | 13,11 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,07 | (0,06) | (0,08) | (0,05) | (0,09) | 0,04 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (3,70) | (3,45) | (5,03) | (3,46) | (5,44) | (3,98) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (3,63) | (3,51) | (5,11) | (3,51) | (5,53) | (3,94) |
| Ausschüttungen | (0,40) | (0,37) | – | (0,37) | – | (0,43) |
| Schlussnettoinventarwert | 8,13 | 7,53 | 11,22 | 7,52 | 12,14 | 8,74 |
| Gesamtertrag | (30,39 %) | (31,29 %) | (31,29 %) | (31,32 %) | (31,30 %) | (30,59 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,78 % | 3,11 % | 3,11 % | 3,11 % | 3,11 % | 2,09 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,73 % | (0,60 %) | (0,63 %) | (0,55 %) | (0,60 %) | 0,41 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse AUD T | Thesaurierende Klasse CHF A | Thesaurierende Klasse EUR A | Thesaurierende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR M | Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) |
|---|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--|
| | AUD | CHF | € | € | € | HKD |
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 14,37 | 13,32 | 7,98 | 17,63 | 10,78 | 8,82 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,12 | 0,15 | 0,09 | 0,34 | 0,02 | 0,10 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,84 | 0,52 | 0,47 | 1,04 | 0,62 | 0,63 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,96 | 0,67 | 0,56 | 1,38 | 0,64 | 0,73 |
| Ausschüttungen | – | – | – | – | – | (0,35) |
| Schlussnettoinventarwert | 15,33 | 13,99 | 8,54 | 19,01 | 11,42 | 9,20 |
| Gesamtertrag | 6,68 % | 5,03 % | 7,02 % | 7,83 % | 5,94 % | 8,62 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,96 % | 1,59 % | 1,67 % | 0,93 % | 2,65 % | 1,70 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,84 % | 1,11 % | 1,17 % | 1,92 % | 0,21 % | 1,15 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 20,70 | 19,35 | 11,56 | 25,33 | 15,75 | 12,92 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,08 | 0,11 | 0,02 | 0,22 | (0,02) | 0,07 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (6,41) | (6,14) | (3,60) | (7,92) | (4,95) | (3,74) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (6,33) | (6,03) | (3,58) | (7,70) | (4,97) | (3,67) |
| Ausschüttungen | – | – | – | – | – | (0,43) |
| Schlussnettoinventarwert | 14,37 | 13,32 | 7,98 | 17,63 | 10,78 | 8,82 |
| Gesamtertrag | (30,58 %) | (31,16 %) | (30,97 %) | (30,40 %) | (31,56 %) | (28,92 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 2,09 % | 1,69 % | 1,71 % | 0,97 % | 2,71 % | 1,74 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,47 % | 0,69 % | 0,20 % | 1,00 % | (0,15 %) | 0,71 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse SGD A SGD | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) US\$ | Thesaurierende Klasse USD A US\$ | Ausschüttende Klasse USD A US\$ | Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) US\$ | Thesaurierende Klasse USD B US\$ |
|---|---------------------------------------|--|--|---------------------------------------|--|--|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 27,99 | 10,15 | 21,92 | 15,81 | 8,45 | 13,48 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,32 | 0,12 | 0,26 | 0,19 | (0,01) | (0,02) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 1,90 | 0,82 | 1,87 | 1,32 | 0,69 | 1,14 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 2,22 | 0,94 | 2,13 | 1,51 | 0,68 | 1,12 |
| Ausschüttungen | – | (0,40) | – | (0,17) | (0,34) | – |
| Schlussnettoinventarwert | 30,21 | 10,69 | 24,05 | 17,15 | 8,79 | 14,60 |
| Gesamtertrag | 7,93 % | 9,67 % | 9,72 % | 9,70 % | 8,32 % | 8,31 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,69 % | 1,70 % | 1,70 % | 1,70 % | 3,01 % | 3,01 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 1,14 % | 1,18 % | 1,20 % | 1,20 % | (0,12 %) | (0,15 %) |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 39,53 | 14,78 | 30,68 | 22,25 | 12,47 | 19,11 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,20 | 0,08 | 0,18 | 0,13 | (0,06) | (0,09) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (11,74) | (4,22) | (8,94) | (6,47) | (3,55) | (5,54) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (11,54) | (4,14) | (8,76) | (6,34) | (3,61) | (5,63) |
| Ausschüttungen | – | (0,49) | – | (0,10) | (0,41) | – |
| Schlussnettoinventarwert | 27,99 | 10,15 | 21,92 | 15,81 | 8,45 | 13,48 |
| Gesamtertrag | (29,19 %) | (28,50 %) | (28,55 %) | (28,53 %) | (29,45 %) | (29,46 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,70 % | 1,75 % | 1,75 % | 1,75 % | 3,05 % | 3,05 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,61 % | 0,69 % | 0,72 % | 0,71 % | (0,57 %) | (0,58 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD C1 US\$ | Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) US\$ | Thesaurierende Klasse USD E US\$ | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) US\$ | Thesaurierende Klasse USD I US\$ | Ausschüttende Klasse USD I US\$ |
|---|---|--|--|--|--|---------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 11,25 | 8,45 | 12,79 | 8,69 | 24,75 | 14,51 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,02 | (0,01) | (0,02) | 0,17 | 0,48 | 0,29 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,95 | 0,69 | 1,08 | 0,71 | 2,13 | 1,22 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,97 | 0,68 | 1,06 | 0,88 | 2,61 | 1,51 |
| Ausschüttungen | – | (0,34) | – | (0,35) | – | (0,27) |
| Schlussnettoinventarwert | 12,22 | 8,79 | 13,85 | 9,22 | 27,36 | 15,75 |
| Gesamtertrag | 8,62 % | 8,32 % | 8,29 % | 10,48 % | 10,55 % | 10,62 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 2,71 % | 3,01 % | 3,01 % | 0,95 % | 0,95 % | 0,95 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,18 % | (0,12 %) | (0,16 %) | 1,98 % | 1,93 % | 1,98 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 15,90 | 12,47 | 18,13 | 12,56 | 34,38 | 20,43 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,05) | (0,06) | (0,09) | 0,15 | 0,42 | 0,25 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (4,60) | (3,55) | (5,25) | (3,60) | (10,05) | (5,94) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (4,65) | (3,61) | (5,34) | (3,45) | (9,63) | (5,69) |
| Ausschüttungen | – | (0,41) | – | (0,42) | – | (0,23) |
| Schlussnettoinventarwert | 11,25 | 8,45 | 12,79 | 8,69 | 24,75 | 14,51 |
| Gesamtertrag | (29,25 %) | (29,45 %) | (29,45 %) | (27,96 %) | (28,01 %) | (28,01 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 2,74 % | 3,05 % | 3,04 % | 1,00 % | 1,00 % | 1,00 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,34 %) | (0,61 %) | (0,62 %) | 1,44 % | 1,46 % | 1,50 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD I2 US\$ | Thesaurierende Klasse USD M US\$ | Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) US\$ | Thesaurierende Klasse USD T US\$ | Thesaurierende Klasse USD Z US\$ | Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich) ZAR |
|---|---|--|--|--|--|---|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 18,19 | 13,12 | 9,72 | 14,79 | 14,36 | 78,11 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,40 | 0,02 | 0,09 | 0,13 | 0,36 | (0,11) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 1,56 | 1,11 | 0,79 | 1,26 | 1,28 | 7,78 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1,96 | 1,13 | 0,88 | 1,39 | 1,64 | 7,67 |
| Ausschüttungen | – | – | (0,39) | – | – | (5,77) |
| Schlussnettoinventarwert | 20,15 | 14,25 | 10,21 | 16,18 | 16,00 | 80,01 |
| Gesamtertrag | 10,78 % | 8,61 % | 9,38 % | 9,40 % | 11,42 % | 10,53 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,74 % | 2,71 % | 2,01 % | 2,00 % | 0,22 % | 2,99 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,19 % | 0,17 % | 0,90 % | 0,90 % | 2,49 % | (0,14 %) |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 25,22 | 18,55 | 14,20 | 20,76 | 19,79 | 117,12 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | 0,38 | (0,05) | 0,05 | 0,07 | 0,35 | (0,55) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (7,41) | (5,38) | (4,06) | (6,04) | (5,78) | (30,67) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (7,03) | (5,43) | (4,01) | (5,97) | (5,43) | (31,22) |
| Ausschüttungen | – | – | (0,47) | – | – | (7,79) |
| Schlussnettoinventarwert | 18,19 | 13,12 | 9,72 | 14,79 | 14,36 | 78,11 |
| Gesamtertrag | (27,87 %) | (29,27 %) | (28,73 %) | (28,76 %) | (27,44 %) | (27,64 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,81 % | 2,75 % | 2,05 % | 2,05 % | 0,24 % | 3,16 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 1,90 % | (0,30 %) | 0,44 % | 0,42 % | 2,09 % | (0,58 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse ZAR B ZAR | Thesaurierende Klasse ZAR C2 ZAR | Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) ZAR | Thesaurierende Klasse ZAR E ZAR | Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) ZAR | Thesaurierende Klasse ZAR T ZAR |
|--|---------------------------------------|--|---|---------------------------------------|---|---------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 162,51 | 160,47 | 78,12 | 181,81 | 120,20 | 223,40 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,23) | (0,34) | (0,10) | (0,32) | 1,02 | 1,93 |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 17,37 | 17,28 | 7,77 | 19,50 | 12,05 | 24,13 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 17,14 | 16,94 | 7,67 | 19,18 | 13,07 | 26,06 |
| Ausschüttungen | – | – | (5,77) | – | (8,91) | – |
| Schlussnettoinventarwert | 179,65 | 177,41 | 80,02 | 200,99 | 124,36 | 249,46 |
| Gesamtertrag | 10,55 % | 10,56 % | 10,53 % | 10,55 % | 11,63 % | 11,67 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 3,01 % | 3,02 % | 3,00 % | 3,00 % | 1,99 % | 1,99 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,14 %) | (0,21 %) | (0,14 %) | (0,17 %) | 0,87 % | 0,85 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 224,68 | 221,86 | 117,13 | 251,37 | 178,43 | 305,79 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (1,15) | (1,13) | (0,53) | (1,16) | 0,61 | 1,28 |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (61,02) | (60,26) | (30,69) | (68,40) | (46,92) | (83,67) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (62,17) | (61,39) | (31,22) | (69,56) | (46,31) | (82,39) |
| Ausschüttungen | – | – | (7,79) | – | (11,92) | – |
| Schlussnettoinventarwert | 162,51 | 160,47 | 78,12 | 181,81 | 120,20 | 223,40 |
| Gesamtertrag | (27,67 %) | (27,67 %) | (27,63 %) | (27,67 %) | (26,91 %) | (26,94 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 3,16 % | 3,16 % | 3,16 % | 3,16 % | 2,12 % | 2,13 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,60 %) | (0,60 %) | (0,56 %) | (0,55 %) | 0,42 % | 0,50 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Small Cap

| | Thesaurierende Klasse AUD B | Thesaurierende Klasse AUD C2 | Thesaurierende Klasse AUD E | Thesaurierende Klasse AUD T | Thesaurierende Klasse EUR A | Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) |
|---|--------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|---|
| | AUD | AUD | AUD | AUD | € | € |
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,86 | 10,59 | 15,20 | 14,04 | 15,29 | 12,63 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,24) | (0,23) | (0,33) | (0,17) | (0,17) | (0,14) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 1,37 | 1,34 | 1,91 | 1,79 | 1,92 | 1,46 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1,13 | 1,11 | 1,58 | 1,62 | 1,75 | 1,32 |
| Schlussnettoinventarwert | 11,99 | 11,70 | 16,78 | 15,66 | 17,04 | 13,95 |
| Gesamtertrag | 10,41 % | 10,48 % | 10,39 % | 11,54 % | 11,45 % | 10,45 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 2,86 % | 2,83 % | 2,86 % | 1,89 % | 1,80 % | 1,81 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (2,09 %) | (2,09 %) | (2,09 %) | (1,13 %) | (1,05 %) | (1,06 %) |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 14,09 | 13,74 | 19,71 | 18,03 | 19,76 | 14,80 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,27) | (0,26) | (0,38) | (0,19) | (0,19) | (0,14) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (2,96) | (2,89) | (4,13) | (3,80) | (4,28) | (2,03) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (3,23) | (3,15) | (4,51) | (3,99) | (4,47) | (2,17) |
| Schlussnettoinventarwert | 10,86 | 10,59 | 15,20 | 14,04 | 15,29 | 12,63 |
| Gesamtertrag | (22,92 %) | (22,93 %) | (22,88 %) | (22,13 %) | (22,62 %) | (14,66 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 3,01 % | 2,98 % | 3,01 % | 1,99 % | 1,82 % | 1,81 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (2,33 %) | (2,27 %) | (2,33 %) | (1,29 %) | (1,15 %) | (1,09 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Small Cap (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert) | Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) | Thesaurierende Klasse EUR M | Thesaurierende Klasse EUR Z |
|--|--------------------------------|---|---|---|--------------------------------|--------------------------------|
| | € | € | € | € | € | € |
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 18,08 | 16,36 | 15,26 | 9,86 | 15,49 | 17,10 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,03) | (0,03) | (0,01) | 0,01 | (0,32) | 0,11 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 2,28 | 1,90 | 1,77 | 1,15 | 1,93 | 2,18 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 2,25 | 1,87 | 1,76 | 1,16 | 1,61 | 2,29 |
| Schlussnettoinventarwert | 20,33 | 18,23 | 17,02 | 11,02 | 17,10 | 19,39 |
| Gesamtertrag | 12,44 % | 11,43 % | 11,53 % | 11,76 % | 10,39 % | 13,39 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,97 % | 0,97 % | 0,80 % | 0,64 % | 2,79 % | 0,14 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,18 %) | (0,19 %) | (0,08 %) | 0,14 % | (1,99 %) | 0,63 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 23,17 | 19,01 | 17,70 | 10,00 | 20,22 | 21,73 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,08) | (0,05) | (0,02) | 0,01 | (0,35) | 0,10 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (5,01) | (2,60) | (2,42) | (0,15) | (4,38) | (4,73) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (5,09) | (2,65) | (2,44) | (0,14) | (4,73) | (4,63) |
| Schlussnettoinventarwert | 18,08 | 16,36 | 15,26 | 9,86 | 15,49 | 17,10 |
| Gesamtertrag | (21,97 %) | (13,94 %) | (13,79 %) | (1,40 %) | (23,39 %) | (21,31 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,99 % | 0,98 % | 0,81 % | 0,62 % | 2,80 % | 0,14 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,38 %) | (0,28 %) | (0,13 %) | 0,15 % | (2,10 %) | 0,53 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Small Cap (Fortsetzung)

| | Ausschüttende Klasse JPY I ¥ | Thesaurierende Klasse USD A US\$ | Ausschüttende Klasse USD A US\$ | Thesaurierende Klasse USD B US\$ | Thesaurierende Klasse USD C2 US\$ | Thesaurierende Klasse USD E US\$ |
|---|------------------------------------|--|---------------------------------------|--|---|--|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 4,82 | 24,40 | 15,75 | 18,10 | 18,12 | 15,96 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,01) | (0,28) | (0,18) | (0,41) | (0,43) | (0,36) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 1,13 | 3,78 | 2,44 | 2,78 | 2,81 | 2,45 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1,12 | 3,50 | 2,26 | 2,37 | 2,38 | 2,09 |
| Schlussnettoinventarwert | 5,94 | 27,90 | 18,01 | 20,47 | 20,50 | 18,05 |
| Gesamtertrag | 23,22 % | 14,34 % | 14,35 % | 13,09 % | 13,13 % | 13,10 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,00 % | 1,84 % | 1,84 % | 2,94 % | 2,97 % | 2,95 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,21 %) | (1,06 %) | (1,06 %) | (2,14 %) | (2,26 %) | (2,13 %) |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 5,21 | 30,47 | 19,67 | 22,86 | 22,89 | 20,15 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,02) | (0,30) | (0,19) | (0,43) | (0,43) | (0,39) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (0,37) | (5,77) | (3,73) | (4,33) | (4,34) | (3,80) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (0,39) | (6,07) | (3,92) | (4,76) | (4,77) | (4,19) |
| Schlussnettoinventarwert | 4,82 | 24,40 | 15,75 | 18,10 | 18,12 | 15,96 |
| Gesamtertrag | (7,47 %) | (19,92 %) | (19,93 %) | (20,82 %) | (20,84 %) | (20,79 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,00 % | 1,85 % | 1,85 % | 2,95 % | 2,94 % | 2,95 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,32 %) | (1,18 %) | (1,16 %) | (2,28 %) | (2,26 %) | (2,29 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Small Cap (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD I US\$ | Ausschüttende Klasse USD I US\$ | Thesaurierende Klasse USD I3 US\$ | Thesaurierende Klasse USD M US\$ | Thesaurierende Klasse USD T US\$ | Thesaurierende Klasse USD Z US\$ |
|---|--|---------------------------------------|---|--|--|--|
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 27,02 | 19,66 | 13.534,58 | 18,23 | 19,89 | 18,32 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,06) | (0,04) | 6,71 | (0,39) | (0,24) | 0,12 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 4,21 | 3,06 | 2.106,60 | 2,79 | 3,08 | 2,86 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 4,15 | 3,02 | 2.113,31 | 2,40 | 2,84 | 2,98 |
| Schlussnettoinventarwert | 31,17 | 22,68 | 15.647,89 | 20,63 | 22,73 | 21,30 |
| Gesamtertrag | 15,36 % | 15,36 % | 15,61 % | 13,17 % | 14,28 % | 16,27 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,99 % | 0,99 % | 0,74 % | 2,85 % | 1,94 % | 0,14 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,21 %) | (0,21 %) | 0,05 % | (2,04 %) | (1,15 %) | 0,63 % |
| 31. Dezember 2022 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 33,46 | 24,35 | 16.717,30 | 22,98 | 24,87 | 22,49 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,08) | (0,07) | 7,33 | (0,44) | (0,26) | 0,10 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (6,36) | (4,62) | (3.190,05) | (4,31) | (4,72) | (4,27) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (6,44) | (4,69) | (3.182,72) | (4,75) | (4,98) | (4,17) |
| Schlussnettoinventarwert | 27,02 | 19,66 | 13.534,58 | 18,23 | 19,89 | 18,32 |
| Gesamtertrag | (19,25 %) | (19,26 %) | (19,04 %) | (20,67 %) | (20,02 %) | (18,54 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | | | | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,00 % | 1,00 % | 0,73 % | 2,85 % | 1,95 % | 0,15 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,29 %) | (0,32 %) | 0,05 % | (2,28 %) | (1,25 %) | 0,54 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Small Cap (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse ZAR E ZAR | Thesaurierende Klasse ZAR T ZAR |
|---|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 31. Dezember 2023 | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 226,59 | 189,12 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (5,32) | (2,35) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 40,35 | 33,79 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 35,03 | 31,44 |
| Schlussnettoinventarwert | 261,62 | 220,56 |
| Gesamtertrag | 15,46 % | 16,62 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 2,94 % | 1,93 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (2,20 %) | (1,15 %) |
| 31. Dezember 2022 | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 279,01 | 230,55 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (5,60) | (2,62) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (46,82) | (38,81) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (52,42) | (41,43) |
| Schlussnettoinventarwert | 226,59 | 189,12 |
| Gesamtertrag | (18,79 %) | (17,97 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 3,06 % | 2,02 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (2,36 %) | (1,32 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Small Cap Intrinsic Value

| | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | Thesaurierende Klasse GBP I2 (nicht währungsgesichert) | Thesaurierende Klasse JPY I3 (nicht währungsgesichert)* | Thesaurierende Klasse USD A | Thesaurierende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD I2 |
|--|---|---|---|--------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|
| | £ | £ | ¥ | US\$ | US\$ | US\$ |
| 31. Dezember 2023 | | | | | | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 10,04 | 9,31 | 1.000,00 | 19,11 | 16,80 | 8,44 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,01) | 0,00 | 0,62 | (0,20) | (0,03) | 0,01 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 0,79 | 0,74 | 11,91 | 2,72 | 2,41 | 1,21 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 0,78 | 0,74 | 12,53 | 2,52 | 2,38 | 1,22 |
| Schlussnettoinventarwert | 10,82 | 10,05 | 1.012,53 | 21,63 | 19,18 | 9,66 |
| Gesamtertrag | 7,77 % | 7,95 % | 1,25 % | 13,19 % | 14,17 % | 14,45 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen
Nettovermögen**

| | | | | | | |
|--------------------------------|----------|--------|--------|----------|----------|--------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 0,98 % | 0,81 % | 0,75 % | 1,85 % | 1,00 % | 0,83 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,13 %) | 0,03 % | 0,19 % | (1,01 %) | (0,15 %) | 0,06 % |

31. Dezember 2022

| | | | | | | |
|--|-----------|-----------|---|-----------|-----------|-----------|
| Eröffnungsnettoinventarwert | 11,24 | 10,40 | – | 24,28 | 21,17 | 10,00 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | | | | | | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,04) | (0,02) | – | (0,25) | (0,07) | (0,01) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto- gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (1,16) | (1,07) | – | (4,92) | (4,30) | (1,55) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (1,20) | (1,09) | – | (5,17) | (4,37) | (1,56) |
| Schlussnettoinventarwert | 10,04 | 9,31 | – | 19,11 | 16,80 | 8,44 |
| Gesamtertrag | (10,68 %) | (10,48 %) | – | (21,29 %) | (20,64 %) | (15,60 %) |

**Verhältnis zum durchschnittlichen
Nettovermögen**

| | | | | | | |
|--------------------------------|----------|----------|---|----------|----------|----------|
| Aufwendungen ⁺⁺ | 1,03 % | 0,85 % | – | 1,85 % | 1,00 % | 0,83 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,37 %) | (0,21 %) | – | (1,25 %) | (0,40 %) | (0,18 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Small Cap Intrinsic Value (Fortsetzung)

| | Thesaurierende Klasse USD M US\$ |
|--|--|
| 31. Dezember 2023 | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 15,88 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,34) |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | 2,25 |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | 1,91 |
| Schlussnettoinventarwert | 17,79 |
| Gesamtertrag | 12,03 % |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 2,85 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (2,02 %) |
| 31. Dezember 2022 | |
| Eröffnungsnettoinventarwert | 20,38 |
| <i>Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:</i> | |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) ⁺ | (0,39) |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten ⁺ | (4,11) |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit | (4,50) |
| Schlussnettoinventarwert | 15,88 |
| Gesamtertrag | (22,08 %) |
| Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen | |
| Aufwendungen ⁺⁺ | 2,85 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (2,25 %) |

⁺ Berechnet auf Basis der durchschnittlichen Anzahl der im Berichtszeitraum im Umlauf befindlichen Anteile.

⁺⁺ Nach Abzug von etwaigen Kostenverzichten. Die Nettokostenquote enthält sowohl die betrieblichen als auch die nicht betrieblichen Kosten und alle erforderlichen Anpassungen, um die angemessenen Rechnungslegungsstandards zu erfüllen.

Die Kennziffern wurden, wo erforderlich, annualisiert.

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt.

¹ Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

² Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE

Der Manager des Fonds ist ein verbundenes Unternehmen von Neuberger Berman Group LLC, einem bei der SEC in den USA registrierten Anlageberater. Die hierin enthaltenen Informationen spiegeln die den allgemein anerkannten Bilanzierungsgrundsätzen der USA entsprechenden Offenlegungen wider, so dass der Manager von bestimmten Ausnahmen Gebrauch machen kann, die ihm gemäß SEC Custody Rule zur Verfügung stehen.

Die Teilfonds können Transaktionen in verschiedenen derivativen Instrumenten tätigen, u. a. in Swaptions, Devisenterminkontrakten, Futures-Kontrakten, Differenzkontrakten, umgekehrten Pensionsgeschäften sowie Aktien-, Index- und Währungsoptionskontrakten, Zins-Swaps, Credit Default Swaps, Cross Currency Swaps, Inflation Swaps und Total Return Swaps.

Derivative Kontrakte sind in der Regel Bestandteil der Anlagestrategie der Teilfonds und werden in erster Linie eingesetzt, um Anlagen zu strukturieren und abzusichern, die Performance zu steigern und die Risiken der Teilfonds zu mindern (der Fonds erfasst keine Derivate als Absicherungsinstrumente zwecks Bilanzierung von Sicherungsgeschäften (Hedge Accounting)).

Der Fonds setzt derivative Finanzinstrumente ein, um seine Risiken wirtschaftlich abzusichern, und zwar in erster Linie das Zinsrisiko und das Fremdwährungsrisiko. Derivate können auch für Handelszwecke eingesetzt werden, wenn der Manager der Ansicht ist, dass dies effektiver ist als eine direkte Anlage in den zugrundeliegenden Finanzinstrumenten.

Derivate beinhalten bei ihrer Auflegung häufig nur ein wechselseitiges Versprechen, und es findet kein oder nur ein geringer Transfer einer konkreten Gegenleistung statt. Diese Instrumente sind jedoch häufig mit einer hohen Hebelwirkung (Leverage) verbunden und sind sehr volatil. Eine relativ geringfügige Veränderung beim Basiswert eines derivativen Kontrakts kann erhebliche Auswirkungen auf den Gewinn oder Verlust des Fonds haben.

Der Manager überwacht im Rahmen des allgemeinen Portfoliomanagements sorgfältig das Derivaterisiko der Teilfonds.

Der beizulegende Zeitwert dieser derivativen Instrumente wird in der Bilanz ausgewiesen, wobei die Veränderungen im beizulegenden Zeitwert unter dem Nettogewinn/-verlust aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten ausgewiesen werden.

Die Teilfonds halten Devisenterminkontrakte, die für währungsgesicherte Anteilklassen spezifisch sind. Wechselkursschwankungen, die diese Devisenterminkontrakte beeinflussen, betreffen nur das Nettovermögen in der entsprechenden Klasse und nicht den Teilfonds als Ganzem. Weitere Informationen zu den Klassen der Devisenterminkontrakte finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestandes.

Die unten in der Tabelle aufgeführten Nennwerte gelten zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 und geben einen Hinweis auf das Volumen der Derivate-Aktivitäten für das Jahr/den Zeitraum. Die Nennwerte geben keinen Hinweis auf das Markt- oder Kreditrisiko.

| Devisenterminkontrakte | Währung | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
|---|---------|-------------------|-------------------|
| | | Nennwert | Nennwert |
| 5G Connectivity | USD | 236.536.022 | 315.672.850 |
| China Bond | CNY | 536.589.074 | 466.298.618 |
| China Equity | USD | 28.710.020 | 30.491.380 |
| CLO Income | USD | 130.534.080 | 76.412.170 |
| Commodities ¹ | USD | 54.148.553 | 34.220.208 |
| Corporate Hybrid Bond | EUR | 1.118.180.142 | 1.362.463.245 |
| Developed Market FMP – 2027 ² | USD | 1.133.780 | - |
| Emerging Market Debt - Hard Currency | USD | 2.657.772.120 | 1.673.599.864 |
| Emerging Market Debt - Local Currency | USD | 1.214.708.531 | 1.436.786.755 |
| Emerging Market Debt Blend | USD | 504.440.886 | 403.481.714 |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | USD | 100.020.133 | 59.461.234 |
| Emerging Markets Equity | USD | 54.678.419 | 41.179.268 |
| Euro Bond Absolute Return | EUR | 35.245.823 | 30.393.822 |
| European High Yield Bond | EUR | 108.348.724 | 65.179.427 |
| Event Driven ¹ | USD | 132.172.668 | 29.205.089 |
| Global Bond | USD | 150.986.080 | 98.358.364 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

| Devisenterminkontrakte (Fortsetzung) | Währung | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
|---|---------|-------------------|-------------------|
| | | Nennwert | Nennwert |
| Global Diversified Income FMP – 2024 | USD | 9.203.545 | 9.331.213 |
| Global Equity Megatrends | USD | 30.481 | - |
| Global Flexible Credit Income | USD | 331.943.470 | 705.321.007 |
| Global High Yield SDG Engagement | USD | 474.540.027 | 349.524.039 |
| Global High Yield Sustainable Action* | USD | - | 5.642.133 |
| Global Investment Grade Credit | USD | 26.767.826 | 24.960.937 |
| Global Opportunistic Bond | USD | 235.063.065 | 121.647.472 |
| Global Real Estate Securities | USD | 23.138.464 | 17.342.893 |
| Global Sustainable Value | USD | 3.119.371 | 3.128.584 |
| High Yield Bond | USD | 1.489.865.792 | 1.349.607.844 |
| InnovAsia 5G | USD | 10.478.005 | 9.698.871 |
| Japan Equity Engagement | JPY | 21.518.936.255 | 13.127.966.057 |
| Macro Opportunities FX | EUR | 182.961.855 | 219.491.178 |
| Multi-Asset Income** | USD | - | 14.560.479 |
| Next Generation Mobility | USD | 975.096 | 7.949.517 |
| Responsible Asian Debt – Hard Currency | USD | 11.722.267 | 3.526.442 |
| Short Duration Emerging Market Debt | USD | 4.010.880.484 | 4.086.532.395 |
| Short Duration High Yield SDG Engagement | USD | 492.272.559 | 400.764.403 |
| Strategic Income | USD | 867.654.333 | 566.633.760 |
| Sustainable Asia High Yield | USD | 502.471 | 5.021.605 |
| Sustainable Emerging Market Corporate Debt | USD | 96.562.462 | 84.435.953 |
| Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency ¹ | USD | 929.547.617 | 145.143.252 |
| Tactical Macro ² | USD | 9.452.752 | - |
| Ultra Short Term Euro Bond | EUR | 78.865.876 | 99.908.396 |
| Uncorrelated Strategies | USD | 5.737.835.188 | 6.286.016.234 |
| Uncorrelated Trading ^{1***} | USD | - | 1.330.232.992 |
| US Equity | USD | 34.549.253 | 36.487.253 |
| US Equity Index PutWrite | USD | 355.813.860 | 316.156.345 |
| US Large Cap Value | USD | 37.851.694 | 20.699.861 |
| US Long Short Equity | USD | 105.191.194 | 115.952.786 |
| US Multi Cap Opportunities | USD | 61.796.292 | 68.451.167 |
| US Real Estate Securities | USD | 78.345.359 | 124.004.185 |
| US Small Cap | USD | 24.099.492 | 23.068.007 |
| US Small Cap Intrinsic Value | USD | 70.545 | - |
| | | | |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | Währung | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
| | | Nennwert | Nennwert |
| Corporate Hybrid Bond | EUR | - | 37.445.575 |
| Short Duration Emerging Market Debt | USD | - | 1.843.240 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

| Differenzkontrakte**** | Währung | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
|--------------------------------------|---------|-------------------|-------------------|
| | | Nennwert | Nennwert |
| Uncorrelated Strategies | USD | 18.527.858.864 | 16.075.343.237 |
| Uncorrelated Trading ^{1***} | USD | - | 5.349.743.324 |
| US Long Short Equity | USD | 28.973.543 | 1.729.270 |

| Optionskontrakte**** | Währung | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
|--------------------------------------|---------|-------------------|-------------------|
| | | Nennwert | Nennwert |
| Multi-Asset Income** | USD | - | 20.339.500 |
| Tactical Macro ² | USD | 85.104.250 | - |
| Uncorrelated Strategies | USD | 244.630.695.031 | 764.870.377.121 |
| Uncorrelated Trading ^{1***} | USD | - | 116.969.966.645 |
| US Equity Index PutWrite | USD | 866.681.500 | 674.205.500 |
| US Long Short Equity | USD | 291.000 | 3.949.500 |

| Futures-Kontrakte**** | Währung | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
|---|---------|-------------------|-------------------|
| | | Nennwert | Nennwert |
| China Bond | CNY | 26.505.043 | 38.886.099 |
| Emerging Market Debt - Hard Currency | USD | 986.812.165 | 822.237.099 |
| Emerging Market Debt - Local Currency | USD | 84.527.494 | 42.455.404 |
| Emerging Market Debt Blend | USD | 51.881.592 | 35.414.447 |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | USD | 24.159.242 | 18.036.421 |
| Euro Bond | EUR | 3.513.575 | 3.271.870 |
| Euro Bond Absolute Return | EUR | 15.781.567 | 35.660.318 |
| Global Bond | USD | 33.535.327 | 35.754.749 |
| Global Flexible Credit Income | USD | 260.557.739 | 162.501.298 |
| Global Opportunistic Bond | USD | 47.022.109 | 51.243.234 |
| Multi-Asset Income** | USD | - | 869.685 |
| Responsible Asian Debt - Hard Currency | USD | 8.954.742 | 3.925.584 |
| Strategic Income | USD | 654.727.669 | 474.617.087 |
| Sustainable Asia High Yield ² | USD | 1.991.269 | 937.591 |
| Sustainable Emerging Market Corporate Debt | USD | 7.050.009 | 7.688.938 |
| Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency ¹ | USD | 297.536.001 | 64.369.018 |
| Tactical Macro ² | USD | 2.715.279 | - |
| Ultra Short Term Euro Bond | EUR | 251.012.145 | 327.521.420 |
| Uncorrelated Strategies | USD | 9.724.843.403 | 9.826.365.666 |
| Uncorrelated Trading ^{1***} | USD | - | 2.525.719.173 |
| US Long Short Equity | USD | 31.749.852 | 13.179.449 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

| Zinsswap-Kontrakte**** | Währung | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
|---|---------|-------------------|-------------------|
| | | Nennwert | Nennwert |
| Emerging Market Debt - Local Currency | USD | 656.595.371 | 821.752.427 |
| Emerging Market Debt Blend | USD | 166.413.907 | 203.755.855 |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | USD | 4.004.768 | 3.716.607 |
| Euro Bond | EUR | 370.031 | 798.031 |
| Euro Bond Absolute Return | EUR | 3.700.000 | 2.700.000 |
| Global Bond | USD | 9.036.298 | 7.904.541 |
| Global Opportunistic Bond | USD | 3.933.342 | 11.239.246 |
| Responsible Asian Debt - Hard Currency | USD | 2.177.818 | - |
| Strategic Income | USD | 41.520.219 | 22.490.454 |
| Ultra Short Term Euro Bond | EUR | 12.479.054 | 62.479.054 |
| Uncorrelated Strategies | USD | 7.325.096.477 | 44.778.595.660 |
| Uncorrelated Trading ^{1***} | USD | - | 7.934.771.768 |

| Credit-Default-Swap-Kontrakte**** | Währung | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
|---|---------|-------------------|-------------------|
| | | Nennwert | Nennwert |
| Emerging Market Debt - Hard Currency | USD | - | 32.640.000 |
| Emerging Market Debt Blend | USD | - | 28.350.680 |
| Euro Bond | EUR | 680.000 | 600.000 |
| Euro Bond Absolute Return | EUR | 2.260.000 | 3.000.000 |
| Global Bond | USD | 3.720.000 | 2.972.291 |
| Global Opportunistic Bond | USD | 15.969.000 | 13.727.919 |
| Strategic Income | USD | 15.523.200 | 13.175.213 |
| Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency ¹ | USD | - | 920.000 |
| Ultra Short Term Euro Bond | EUR | 27.200.000 | 50.000.000 |
| Uncorrelated Strategies | USD | 79.163.211 | 61.521.538 |
| Uncorrelated Trading ^{1***} | USD | - | 4.323.083 |

| Total Return Swap-Kontrakte**** | Währung | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2022 |
|--------------------------------------|---------|-------------------|-------------------|
| | | Nennwert | Nennwert |
| CLO Income | USD | 4.999.582 | 13.500.000 |
| Commodities ¹ | USD | 152.007.385 | 84.753.608 |
| European High Yield Bond | EUR | 10.018.326 | - |
| Event Driven ¹ | USD | 103.060.180 | 38.432.156 |
| Global Flexible Credit Income | USD | 28.497.618 | 25.001.730 |
| Global High Yield SDG Engagement | USD | - | 37.950.000 |
| High Yield Bond | USD | 25.000.000 | 16.000.000 |
| Strategic Income | USD | 73.680.000 | 126.680.000 |
| Uncorrelated Strategies | USD | 212.596.112 | 297.054.845 |
| Uncorrelated Trading ^{1***} | USD | - | 8.674.407 |
| US Long Short Equity | USD | 17.801.276 | 34.605.119 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

| Swaptions | Währung | 31. Dezember 2023 Nennwert | 31. Dezember 2022 Nennwert |
|--------------------------------------|---------|-------------------------------|-------------------------------|
| Strategic Income | USD | 22.093.100 | - |
| Uncorrelated Strategies | USD | 1.159.882.479 | 1.632.559.980 |
| Uncorrelated Trading ^{1***} | USD | - | 256.139.995 |

| Inflation Swap-Kontrakte**** | Währung | 31. Dezember 2023 Nennwert | 31. Dezember 2022 Nennwert |
|------------------------------|---------|-------------------------------|-------------------------------|
| Euro Bond | EUR | 750.000 | 250.000 |
| Euro Bond Absolute Return | EUR | 3.000.000 | 10.997.950 |
| Ultra Short Term Euro Bond | EUR | 60.000.000 | 25.000.000 |
| Uncorrelated Strategies | USD | - | 623.548.271 |

| Volatility-Swap-Kontrakte**** | Währung | 31. Dezember 2023 Nennwert | 31. Dezember 2022 Nennwert |
|--------------------------------------|---------|-------------------------------|-------------------------------|
| Uncorrelated Strategies | USD | 10.275.687.487 | 8.644.681.560 |
| Uncorrelated Trading ^{1***} | USD | - | 470.373.765 |

| Variance-Swap-Kontrakte**** | Währung | 31. Dezember 2023 Nennwert | 31. Dezember 2022 Nennwert |
|--------------------------------------|---------|-------------------------------|-------------------------------|
| Uncorrelated Strategies | USD | 7.442.979 | 2.793.362 |
| Uncorrelated Trading ^{1***} | USD | - | 1.413.362 |

| Correlation-Swap-Kontrakte**** | Währung | 31. Dezember 2023 Nennwert | 31. Dezember 2022 Nennwert |
|--------------------------------------|---------|-------------------------------|-------------------------------|
| Uncorrelated Strategies | USD | 5.000.000 | 13.270.000 |
| Uncorrelated Trading ^{1***} | USD | - | 1.000.000 |

* Das Portfolio wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

** Das Portfolio wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

*** Das Portfolio wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

**** Die angezeigten Beträge sind absolute Nennwerte.

¹ Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

² Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

Der realisierte Nettogewinn/(-verlust) und die Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 sowie die Beträge, die im Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten innerhalb der Gewinn- und Verlustrechnung erfasst wurden, sind wie folgt (Beträge in der jeweiligen Basiswährung der Portfolios):

| | Wechselkursrisiko | | Zinsrisiko | | Eigenkapitalrisiko | | Kreditrisiko | |
|--|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
| | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) |
| 5G Connectivity | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | 5.192.363 | (3.552.805) | - | - | - | - | - | - |
| China Bond | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | 13.714.698 | (1.637.908) | - | - | - | - | - | - |
| Futures-Kontrakte | - | - | (3.254.641) | 641.419 | - | - | - | - |
| China Equity | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | 184.079 | (158.273) | - | - | - | - | - | - |
| CLO Income | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | 3.533.994 | (2.503.040) | - | - | - | - | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | - | - | - | - | 314.738 | 383.055 |
| Commodities ¹ | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | 1.062.795 | 176.812 | - | - | - | - | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | - | - | (13.495.759) | - | - | - |
| Corporate Hybrid Bond | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (2.362.877) | (11.919.193) | - | - | - | - | - | - |
| Developed Market FMP – 2027 ² | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (25.249) | 39.476 | - | - | - | - | - | - |
| Emerging Market Debt - Hard Currency | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (10.104.061) | 17.367.203 | - | - | - | - | - | - |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

| | Wechselkursrisiko | | Zinsrisiko | | Eigenkapitalrisiko | | Kreditrisiko | |
|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
| | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) |
| Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung) | | | | | | | | |
| Futures-Kontrakte | - | - | (12.892.426) | (12.494.331) | - | - | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | - | - | - | - | 904.188 | (1.909.636) |
| Emerging Market Debt - Local Currency | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | 11.460.818 | (487.320) | - | - | - | - | - | - |
| Futures-Kontrakte | - | - | 197.184 | 273.385 | - | - | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | (34.175.882) | 34.762.871 | - | - | - | - |
| Emerging Market Debt Blend | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | 2.131.413 | 2.590.338 | - | - | - | - | - | - |
| Futures-Kontrakte | - | - | (1.123.477) | (786.259) | - | - | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | (3.699.073) | 3.557.307 | - | - | (1.408.426) | (1.658.685) |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (3.206.578) | 1.934.611 | - | - | - | - | - | - |
| Futures-Kontrakte | - | - | (886.171) | (68.929) | - | - | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | (94.090) | 73.032 | - | - | - | - |
| Emerging Markets Equity | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (2.109) | 98.303 | - | - | - | - | - | - |
| Euro Bond | | | | | | | | |
| Futures-Kontrakte | - | - | (14.161) | 53.871 | - | - | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | 1.073 | 27.954 | - | - | (31.470) | (47.958) |
| Euro Bond Absolute Return | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (357.013) | (100.045) | - | - | - | - | - | - |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

| | Wechselkursrisiko | | Zinsrisiko | | Eigenkapitalrisiko | | Kreditrisiko | |
|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
| | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) |
| Euro Bond Absolute Return (Fortsetzung) | | | | | | | | |
| Futures-Kontrakte | - | - | 1.146.748 | (1.649.016) | - | - | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | 40.607 | 162.305 | - | - | (147.516) | (148.450) |
| European High Yield Bond | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (1.982.496) | 1.216.114 | - | - | - | - | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | - | - | - | - | (9.760) | 18.355 |
| Event Driven ¹ | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | 206.153 | 3.003.125 | - | - | - | - | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | - | - | - | - | 1.227.916 | 941.165 |
| Global Bond | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (1.032.207) | (588.150) | - | - | - | - | - | - |
| Futures-Kontrakte | - | - | 340.673 | (261.309) | - | - | - | - |
| Optionskontrakte | - | - | (14.000) | - | - | - | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | 221.533 | 123.475 | - | - | 3.562 | (59.106) |
| Global Diversified Income FMP–2024 | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | 410.477 | (241.838) | - | - | - | - | - | - |
| Global Equity Megatrends | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | - | 444 | - | - | - | - | - | - |
| Global Flexible Credit Income | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | 23.332.772 | (13.492.432) | - | - | - | - | - | - |
| Futures-Kontrakte | - | - | 2.424.244 | (1.391.731) | - | - | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | - | - | - | - | 249.754 | 900.363 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

| | Wechselkursrisiko | | Zinsrisiko | | Eigenkapitalrisiko | | Kreditrisiko | |
|---------------------------------------|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
| | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) |
| Global High Yield SDG Engagement | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | 2.790.595 | 1.750.164 | - | - | - | - | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | - | - | - | - | 301.493 | (13.411) |
| Global High Yield Sustainable Action* | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (430.114) | 350.409 | - | - | - | - | - | - |
| Global Investment Grade Credit | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (1.050.604) | 520.360 | - | - | - | - | - | - |
| Global Opportunistic Bond | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (1.960.311) | 883.559 | - | - | - | - | - | - |
| Futures-Kontrakte | - | - | (646.937) | 521.019 | - | - | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | (71.440) | (17.226) | - | - | (1.285.179) | (1.018.186) |
| Global Real Estate Securities | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | 448.253 | (546.458) | - | - | - | - | - | - |
| Global Sustainable Value | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | 20.982 | (15.305) | - | - | - | - | - | - |
| High Yield Bond | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | 12.174.201 | (5.197.021) | - | - | - | - | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | - | - | - | - | 240.943 | 353.035 |
| InnovAsia 5G | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | 212.374 | (135.608) | - | - | - | - | - | - |
| Japan Equity Engagement | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | 1.239.623.973 | 183.165.732 | - | - | - | - | - | - |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

| | Wechselkursrisiko | | Zinsrisiko | | Eigenkapitalrisiko | | Kreditrisiko | |
|--|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
| | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) |
| Macro Opportunities FX | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (2.127.786) | 824.969 | - | - | - | - | - | - |
| Futures-Kontrakte | - | - | 8.828 | - | - | - | - | - |
| Multi-Asset Income* | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (540.982) | 423.900 | - | - | - | - | - | - |
| Futures-Kontrakte | - | - | 4.128 | (40.257) | (2.851) | (7.781) | - | - |
| Optionskontrakte | - | - | - | - | 226.839 | 55.510 | - | - |
| Next Generation Mobility | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | 65.632 | (70.243) | - | - | - | - | - | - |
| Responsible Asian Debt - Hard Currency | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (84.287) | 42.076 | - | - | - | - | - | - |
| Futures-Kontrakte | - | - | 246.941 | 84.106 | - | - | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | 17.942 | 554 | - | - | (1.774) | - |
| Short Duration Emerging Market Debt | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (41.340.360) | 32.707.080 | - | - | - | - | - | - |
| Short Duration High Yield SDG Engagement | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (8.357.412) | (5.584.858) | - | - | - | - | - | - |
| Strategic Income | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (14.302.284) | (7.621.460) | - | - | - | - | - | - |
| Futures-Kontrakte | - | - | 24.458.245 | (16.418.065) | - | - | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | (55.651) | 214.167 | - | - | 8.912.186 | 5.302.649 |
| Swaptions | - | - | - | - | - | - | (1.003) | 15.122 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

| | Wechselkursrisiko | | Zinsrisiko | | Eigenkapitalrisiko | | Kreditrisiko | |
|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
| | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) |
| Sustainable Asia High Yield | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | 309.753 | (236.678) | - | - | - | - | - | - |
| Futures-Kontrakte | - | - | 52.309 | (47.496) | - | - | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | - | - | - | - | (1.885) | - |
| Sustainable Emerging Market Corporate Debt | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | 580.387 | 951.841 | - | - | - | - | - | - |
| Futures-Kontrakte | - | - | 404.614 | (251.450) | - | - | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | - | - | - | - | (21.639) | - |
| Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency ¹ | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (8.837.398) | 6.354.956 | - | - | - | - | - | - |
| Futures-Kontrakte | - | - | (8.439.258) | 1.469.059 | - | - | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | - | - | - | - | (129.166) | (53.826) |
| Tactical Macro ² | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (15.490) | 30.520 | - | - | - | - | - | - |
| Futures-Kontrakte | - | - | 88.726 | (19.364) | - | - | - | - |
| Optionskontrakte | 35.570 | (80.493) | 35.286 | (4.131) | 7.969 | (22.675) | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | (17.694) | - | 20.220 | - | - | - |
| Ultra Short Term Euro Bond | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (5.209.978) | 4.062.314 | - | - | - | - | - | - |
| Futures-Kontrakte | - | - | 6.652.152 | (9.957.859) | - | - | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | (104.982) | 1.716.421 | - | - | (1.827.198) | (1.635.504) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

| | Wechselkursrisiko | | Zinsrisiko | | Eigenkapitalrisiko | | Kreditrisiko | |
|------------------------------------|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
| | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) |
| Uncorrelated Strategies | | | | | | | | |
| Differenzkontrakte | - | - | - | - | (38.284.984) | 66.830.536 | - | - |
| Devisenterminkontrakte | 194.838.411 | (135.694.188) | - | - | - | - | - | - |
| Futures-Kontrakte | (12.511) | (465.602) | (57.783.403) | (23.399.970) | (214.065) | 2.337.191 | - | - |
| Optionskontrakte | (5.650.286) | (977.722) | (45.886.349) | 21.433.917 | (91.796.907) | (8.714.110) | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | 30.631.005 | (47.398.570) | (18.554.766) | (18.067.170) | (812.024) | (1.430.223) |
| Swaptions | - | - | - | - | - | - | (8.831.969) | (669.209) |
| Uncorrelated Trading ^{1*} | | | | | | | | |
| Differenzkontrakte | - | - | - | - | 86.773.401 | (10.664.847) | - | - |
| Devisenterminkontrakte | 47.134.508 | (48.168.205) | - | - | - | - | - | - |
| Futures-Kontrakte | - | (267.113) | (85.165.159) | (3.388.046) | - | 55.918 | - | - |
| Optionskontrakte | 18.261 | (31.049) | 932.386 | (5.901.762) | (16.637.386) | 12.495.011 | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | 782.103 | (23.822) | (4.798.143) | (1.055.312) | (317.578) | 47.926 |
| Swaptions | - | - | - | - | - | - | (162.308) | (48.110) |
| US Equity | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (2.356.287) | (476.620) | - | - | - | - | - | - |
| US Equity Index PutWrite | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | 17.968.715 | (3.650.755) | - | - | - | - | - | - |
| Optionskontrakte | - | - | - | - | 69.891.783 | 7.680.530 | - | - |
| US Large Cap Value | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | 213.781 | 132.060 | - | - | - | - | - | - |
| US Long Short Equity | | | | | | | | |
| Differenzkontrakte | - | - | - | - | (374.469) | (3.986.584) | - | - |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

| | Wechselkursrisiko | | Zinsrisiko | | Eigenkapitalrisiko | | Kreditrisiko | |
|------------------------------------|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
| | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) |
| US Long Short Equity (Fortsetzung) | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | 3.889.440 | (2.923.219) | - | - | - | - | - | - |
| Futures-Kontrakte | - | - | - | - | (4.880.547) | (1.473.682) | - | - |
| Optionskontrakte | - | - | - | - | 405.975 | 58.646 | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | - | - | (641.328) | (4.599.498) | - | - |
| US Multi Cap Opportunities | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | 225.651 | (630.018) | - | - | - | - | - | - |
| US Real Estate Securities | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (421.811) | (942.444) | - | - | - | - | - | - |
| US Small Cap | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (13.823) | (102.532) | - | - | - | - | - | - |
| US Small Cap Intrinsic Value | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | - | (398) | - | - | - | - | - | - |

Der realisierte Nettogewinn/(-verlust) und die Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 sowie die Beträge, die im Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten innerhalb der Gewinn- und Verlustrechnung erfasst wurden, sind wie folgt (Beträge in der jeweiligen Basiswährung der Portfolios):

| | Wechselkursrisiko | | Zinsrisiko | | Eigenkapitalrisiko | | Kreditrisiko | |
|---------------------------------|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
| | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) |
| 5G Connectivity | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (34.344.868) | 13.655.498 | - | - | - | - | - | - |
| Absolute Return Multi Strategy* | | | | | | | | |
| Differenzkontrakte | - | - | - | - | (7.199) | 11.507 | - | - |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

| | Wechselkursrisiko | | Zinsrisiko | | Eigenkapitalrisiko | | Kreditrisiko | |
|---------------------------------------|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
| | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) |
| China Bond | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | 21.788.314 | 1.834.914 | - | - | - | - | - | - |
| Futures-Kontrakte | - | - | 397.557 | 376.843 | - | - | - | - |
| China Equity | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (861.539) | 353.434 | - | - | - | - | - | - |
| CLO Income | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (9.039.612) | 2.915.180 | - | - | - | - | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | - | - | - | - | (1.114.339) | (426.769) |
| Commodities ¹ | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (1.341.444) | 1.186.450 | - | - | - | - | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | - | - | - | - | (2.192.655) | - |
| Corporate Hybrid Bond | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (15.809.097) | 18.274.199 | - | - | - | - | - | - |
| Emerging Market Debt - Hard Currency | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (78.939.684) | (8.691.729) | - | - | - | - | - | - |
| Futures-Kontrakte | - | - | 628.973 | 8.154.605 | - | - | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | - | - | - | - | (7.765.872) | 1.909.636 |
| Emerging Market Debt - Local Currency | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | 8.599.439 | (3.428.586) | - | - | - | - | - | - |
| Futures-Kontrakte | - | - | 3.755.166 | (520.080) | - | - | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | (88.998.948) | 1.486.967 | - | - | - | - |
| Emerging Market Debt Blend | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (22.804.911) | (1.661.584) | - | - | - | - | - | - |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

| | Wechselkursrisiko | | Zinsrisiko | | Eigenkapitalrisiko | | Kreditrisiko | |
|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
| | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) |
| Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung) | | | | | | | | |
| Futures-Kontrakte | - | - | 4.186.757 | (381.781) | - | - | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | (19.525.431) | 1.960.832 | - | - | (1.050.415) | 1.658.685 |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (1.082.921) | (403.699) | - | - | - | - | - | - |
| Futures-Kontrakte | - | - | (286.000) | 295.644 | - | - | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | (390.025) | 51.099 | - | - | 7.490 | - |
| Emerging Markets Equity | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (1.957.650) | 597.444 | - | - | - | - | - | - |
| Euro Bond | | | | | | | | |
| Futures-Kontrakte | - | - | 108.706 | (65.437) | - | - | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | 63.482 | (44.999) | - | - | 50.723 | 99.719 |
| Euro Bond Absolute Return | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | 2.236.954 | (1.200.201) | - | - | - | - | - | - |
| Futures-Kontrakte | - | - | 3.543.656 | 981.478 | - | - | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | 779.826 | (206.284) | - | - | 260.191 | 439.571 |
| European High Yield Bond | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | 5.167.949 | (2.310.995) | - | - | - | - | - | - |
| Event Driven ¹ | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (13.858) | 899.453 | - | - | - | - | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | - | - | - | - | 313.692 | 18.364 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

| | Wechselkursrisiko | | Zinsrisiko | | Eigenkapitalrisiko | | Kreditrisiko | |
|--------------------------------------|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
| | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) |
| Global Bond | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (2.361.521) | 400.741 | - | - | - | - | - | - |
| Futures-Kontrakte | - | - | 609.985 | 431.813 | - | - | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | 428.391 | 23.192 | - | - | 150.351 | (90.970) |
| Global Diversified Income FMP–2024 | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (1.113.567) | 576.942 | - | - | - | - | - | - |
| Global Equity Megatrends | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (18) | - | - | - | - | - | - | - |
| Global Flexible Credit Income | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (68.588.731) | 19.348.780 | - | - | - | - | - | - |
| Futures-Kontrakte | - | - | 33.526.553 | 2.325.216 | - | - | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | - | - | - | - | (4.875.341) | (1.434.469) |
| Swaptions | - | - | - | - | - | - | 80.560 | 4.894 |
| Global High Yield SDG Engagement | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (6.766.315) | 3.781.363 | - | - | - | - | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | - | - | - | - | (4.592) | 13.411 |
| Global High Yield Sustainable Action | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | 778.395 | (409.366) | - | - | - | - | - | - |
| Global Investment Grade Credit | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | 4.793.821 | (2.081.880) | - | - | - | - | - | - |
| Global Opportunistic Bond | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | 6.821.249 | (3.237.790) | - | - | - | - | - | - |
| Futures-Kontrakte | - | - | (1.155.660) | 74.259 | - | - | - | - |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

| | Wechselkursrisiko | | Zinsrisiko | | Eigenkapitalrisiko | | Kreditrisiko | |
|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
| | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) |
| Global Opportunistic Bond (Fortsetzung) | | | | | | | | |
| Swap-Kontrakte | - | - | (758) | 30.702 | - | - | 835.892 | 2.024.541 |
| Global Real Estate Securities | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (2.134.514) | 906.198 | - | - | - | - | - | - |
| Global Sustainable Equity | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | 13 | - | - | - | - | - | - | - |
| Global Sustainable Value | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (105.940) | 45.453 | - | - | - | - | - | - |
| High Yield Bond | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (74.656.641) | 50.120.907 | - | - | - | - | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | - | - | - | - | (238.629) | (1.063.058) |
| InnovAsia 5G | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (1.110.501) | 484.488 | - | - | - | - | - | - |
| Japan Equity Engagement | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | 681.276.741 | (97.210.699) | - | - | - | - | - | - |
| Macro Opportunities FX | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (1.503.902) | (18.792) | - | - | - | - | - | - |
| Multi-Asset Income | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | 916.535 | (482.244) | - | - | - | - | - | - |
| Futures-Kontrakte | - | - | 198.584 | 33.623 | (9.147) | 7.781 | - | - |
| Optionskontrakte | - | - | - | - | (468.909) | (38.953) | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | - | - | 194 | (2.121) | - | - |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

| | Wechselkursrisiko | | Zinsrisiko | | Eigenkapitalrisiko | | Kreditrisiko | |
|--|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
| | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) |
| Next Generation Mobility | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (808.298) | 179.277 | - | - | - | - | - | - |
| Responsible Asian Debt - Hard Currency | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | 95.145 | (53.507) | - | - | - | - | - | - |
| Futures-Kontrakte | - | - | 227.141 | 52.911 | - | - | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | 3.333 | (4.908) | - | - | - | - |
| Short Duration Emerging Market Debt | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (403.920.805) | 19.021.418 | - | - | - | - | - | - |
| Short Duration High Yield SDG Engagement | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (55.455.517) | 21.866.711 | - | - | - | - | - | - |
| Strategic Income | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (74.954.126) | 24.788.769 | - | - | - | - | - | - |
| Futures-Kontrakte | - | - | 53.107.795 | 5.375.960 | - | - | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | (540.221) | (243.829) | - | - | (9.575.369) | (6.211.370) |
| Sustainable Asia High Yield | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (3.848.434) | 253.108 | - | - | - | - | - | - |
| Futures-Kontrakte | - | - | 264.520 | 10.935 | - | - | - | - |
| Sustainable Emerging Market Corporate Debt | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (6.903.324) | 262.510 | - | - | - | - | - | - |
| Futures-Kontrakte | - | - | 2.013.756 | (46.228) | - | - | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | - | - | - | - | (385) | - |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

| | Wechselkursrisiko | | Zinsrisiko | | Eigenkapitalrisiko | | Kreditrisiko | |
|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
| | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) |
| Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency ¹ | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (3.200.125) | 375.279 | - | - | - | - | - | - |
| Futures-Kontrakte | - | - | (884.014) | 2.466.299 | - | - | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | - | - | - | - | (258.198) | 53.826 |
| Ultra Short Term Euro Bond | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | 15.556.930 | (7.308.456) | - | - | - | - | - | - |
| Futures-Kontrakte | - | - | 21.706.368 | 4.200.214 | - | - | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | 2.573.798 | (2.325.045) | - | - | 2.234.039 | 3.351.766 |
| Uncorrelated Strategies | | | | | | | | |
| Differenzkontrakte | - | - | - | - | (75.358.014) | (12.335.649) | - | - |
| Devisenterminkontrakte | (395.704.157) | 191.661.278 | - | - | - | - | - | - |
| Futures-Kontrakte | 65.592.148 | 1.797.289 | 289.296.178 | 32.243.865 | 25.921.705 | (1.228.836) | - | - |
| Optionskontrakte | (4.841.697) | (89.564) | (47.455.691) | 13.905.598 | (10.770.042) | (6.431.124) | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | (34.100.737) | 44.421.655 | (6.250.384) | 32.687.227 | 429.240 | 1.030.699 |
| Swaptions | - | - | - | - | - | - | (2.826.480) | 337.180 |
| Uncorrelated Trading ¹ | | | | | | | | |
| Differenzkontrakte | - | - | - | - | (86.214.611) | 10.664.847 | - | - |
| Devisenterminkontrakte | (49.448.101) | 48.168.205 | - | - | - | - | - | - |
| Futures-Kontrakte | (4.908.877) | 267.113 | 92.877.614 | 3.388.046 | 3.487.382 | (55.918) | - | - |
| Optionskontrakte | 2.464 | 31.049 | (5.203.204) | 5.862.351 | (3.718.815) | (12.495.011) | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | (16.847) | 23.822 | (957.745) | 1.055.312 | 220.296 | (47.926) |
| Swaptions | - | - | - | - | - | - | (779.292) | 48.110 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

| | Wechselkursrisiko | | Zinsrisiko | | Eigenkapitalrisiko | | Kreditrisiko | |
|----------------------------|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
| | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) |
| US Equity | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (2.263.323) | 1.611.149 | - | - | - | - | - | - |
| US Equity Index PutWrite | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (39.013.051) | 14.321.515 | - | - | - | - | - | - |
| Optionskontrakte | - | - | - | - | (51.698.219) | (9.262.537) | - | - |
| US Large Cap Value | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (551.371) | 871.125 | - | - | - | - | - | - |
| US Long Short Equity | | | | | | | | |
| Differenzkontrakte | - | - | - | - | 9.575.763 | 2.406.289 | - | - |
| Devisenterminkontrakte | (20.069.073) | 9.726.320 | - | - | - | - | - | - |
| Futures-Kontrakte | - | - | 252.059 | 234 | 9.712.450 | 1.232.318 | - | - |
| Optionskontrakte | - | - | - | - | 48.013 | (68.616) | - | - |
| Swap-Kontrakte | - | - | - | - | (1.409.044) | 12.988.292 | - | - |
| US Multi Cap Opportunities | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (4.218.776) | 2.763.511 | - | - | - | - | - | - |
| US Real Estate Securities | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (12.175.067) | 5.848.700 | - | - | - | - | - | - |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

| | Wechselkursrisiko | | Zinsrisiko | | Eigenkapitalrisiko | | Kreditrisiko | |
|------------------------------|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
| | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) |
| US Small Cap | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | (3.061.212) | 1.174.184 | - | - | - | - | - | - |
| US Small Cap Intrinsic Value | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | 1.730 | - | - | - | - | - | - | - |

* Der Teilfonds wurde während des aktuellen oder vorherigen Berichtsjahres aufgelöst.

¹ Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

² Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR**25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)****Bedingte Merkmale in Bezug auf das Kreditrisiko**

Die derivativen Kontrakte der Teilfonds unterliegen dem International Swaps and Derivatives Association Master Agreement (ISDA), das bestimmte Verpflichtungen und andere Bestimmungen enthält, wonach der Fonds möglicherweise zusätzliche Sicherheiten für Derivate stellen oder diese Kontrakte kündigen muss, wenn der Fonds nicht über eine ausreichende Anlagendeckung (Asset Coverage) für seine Kontrakte verfügt oder sein Nettovermögen um einen festgelegten Prozentsatz oder Betrag sinkt. Die Teilfonds gingen im Rahmen ihrer Anlagestrategien Credit Default Swaps ein, um sich gegen nachteilige Veränderungen im Wert von Anlagen abzusichern und sich vor nachteiligen Änderungen der Zinssätze oder der Kreditperformance von Gegenparteien zu schützen. Der maximale potenzielle Betrag, den die Teilfonds als Verkäufer eines Kreditschutzes eventuell zahlen müssen, wenn ein Kreditereignis eintritt, belief sich zum 31. Dezember 2023 auf 127.047.007 US\$ (31. Dezember 2022: 120.546.104 US\$). Die Summe des Zeitwerts aller Credit Default Swaps in Nettovermögensposition betrug zum 31. Dezember 2023 (3.082.098) US\$ (31. Dezember 2022: (4.166.005) US\$). Der Fonds hielt zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 keine derivativen Instrumente mit bedingten Merkmalen in Bezug auf das Kreditrisiko.

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN

Der Manager des Fonds ist ein verbundenes Unternehmen von Neuberger Berman Group LLC, einem bei der SEC in den USA registrierten Anlageberater. Die hierin enthaltenen Informationen spiegeln die den allgemein anerkannten Bilanzierungsgrundsätzen der USA entsprechenden Offenlegungen wider, so dass der Manager von bestimmten Ausnahmen Gebrauch machen kann, die ihm gemäß SEC Custody Rule zur Verfügung stehen.

Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten werden nur dann saldiert und der Nettobetrag in der Bilanz ausgewiesen, wenn ein Rechtsanspruch besteht, die erfassten Beträge miteinander zu verrechnen und beabsichtigt wird, entweder den Ausgleich auf Nettobasis herbeizuführen oder gleichzeitig mit der Verwertung der betreffenden Vermögenswerte die dazugehörigen Verbindlichkeiten abzulösen.

Im Rahmen der finanziellen Berichterstattung nimmt der Fonds keine Saldierung von derivativen Vermögenswerten und derivativen Verbindlichkeiten in der Bilanz vor. Die folgenden Tabellen zeigen die außerbörslichen Derivategeschäfte (OTC-Derivate), Vermögenswerte aus Wertpapierleihgeschäften und Verbindlichkeiten des Fonds nach Gegenparteien, abzüglich von Beträgen, die im Rahmen eines Master Netting Agreements für eine Saldierung verfügbar sind, und abzüglich der zugehörigen Sicherheiten, die der Fonds zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 für Vermögenswerte erhalten hat und vom Fonds für Verbindlichkeiten hinterlegt wurden.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

5G Connectivity

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten | |
|------------------------|--|--|---|--|
| | US\$ | | US\$ | |
| Devisenterminkontrakte | 6.342.222 | | (1.033.321) | |
| Insgesamt | 6.342.222 | | (1.033.321) | |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|--------------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| BNP Paribas | - | - | - | - | (58) | - | - | (58) |
| Goldman Sachs International | 370.835 | (215.169) | - | 155.666 | (215.169) | 215.169 | - | - |
| Standard Chartered Bank | 16.571 | (16.571) | - | - | (85.735) | 16.571 | - | (69.164) |
| State Street Bank and Trust Co | 40.673 | (40.673) | - | - | (63.143) | 40.673 | - | (22.470) |
| UBS AG | 3.896.298 | (69.056) | - | 3.827.242 | (69.056) | 69.056 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 2.017.845 | (600.160) | - | 1.417.685 | (600.160) | 600.160 | - | - |
| Insgesamt | 6.342.222 | (941.629) | - | 5.400.593 | (1.033.321) | 941.629 | - | (91.692) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

5G Connectivity (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten | |
|------------------------|--|--|---|--|
| | US\$ | | US\$ | |
| Devisenterminkontrakte | 12.141.765 | | (3.280.059) | |
| Insgesamt | 12.141.765 | | (3.280.059) | |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | | |
|--------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|--|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | |
| Goldman Sachs International | 541.183 | (312.602) | - | 228.581 | (312.602) | 312.602 | - | - | |
| Standard Chartered Bank | - | - | - | - | (63.294) | - | - | (63.294) | |
| State Street Bank and Trust Co | 165.112 | (165.112) | - | - | (610.428) | 165.112 | - | (445.316) | |
| UBS AG | 148.500 | (148.500) | - | - | (315.586) | 148.500 | - | (167.086) | |
| Westpac Banking Corp | 11.286.970 | (1.978.149) | - | 9.308.821 | (1.978.149) | 1.978.149 | - | - | |
| Insgesamt | 12.141.765 | (2.604.363) | - | 9.537.402 | (3.280.059) | 2.604.363 | - | (675.696) | |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

China Bond

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | CNY | CNY |
| Devisenterminkontrakte | 1.943.751 | (2.361.945) |
| Insgesamt | 1.943.751 | (2.361.945) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-------------------------|--|---|-------------------------------|--------------------|--|--|---------------------------------|--------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge CNY | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten CNY | Erhaltene Sicherheiten(a) CNY | Nettobetrag(b) CNY | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge CNY | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte CNY | Verpfändete Sicherheiten(a) CNY | Nettobetrag(b) CNY |
| Citibank NA | 1.917.777 | (333.720) | - | 1.584.057 | (333.720) | 333.720 | - | - |
| JPMorgan Chase Bank | 1.318 | (56) | - | 1.262 | (56) | 56 | - | - |
| Standard Chartered Bank | 24.656 | (24.656) | - | - | (209.677) | 24.656 | - | (185.021) |
| UBS AG | - | - | - | - | (1.818.492) | - | - | (1.818.492) |
| Insgesamt | 1.943.751 | (358.432) | - | 1.585.319 | (2.361.945) | 358.432 | - | (2.003.513) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

China Bond (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | CNY | CNY |
| Devisenterminkontrakte | 3.921.557 | (2.701.843) |
| Insgesamt | 3.921.557 | (2.701.843) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|--|---|---|--------------------------------|--|--|---|--------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge CNY | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten CNY | Erhaltene Sicherheiten ^(a) CNY | Nettobetrag ^(b) CNY | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge CNY | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte CNY | Verpfändete Sicherheiten ^(a) CNY | Nettobetrag ^(b) CNY |
| Citibank NA | 68.042 | (68.042) | - | - | (156.782) | 68.042 | - | (88.740) |
| Goldman Sachs International | 1.680.891 | - | - | 1.680.891 | - | - | - | - |
| JPMorgan Chase Bank | - | - | - | - | (2.520.269) | - | - | (2.520.269) |
| Standard Chartered Bank | 1.992.935 | - | - | 1.992.935 | - | - | - | - |
| UBS AG | 162.642 | (24.648) | - | 137.994 | (24.648) | 24.648 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 17.047 | (144) | - | 16.903 | (144) | 144 | - | - |
| Insgesamt | 3.921.557 | (92.834) | - | 3.828.723 | (2.701.843) | 92.834 | - | (2.609.009) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

China Equity

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 547.220 | (423.344) |
| Insgesamt | 547.220 | (423.344) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|--|---|-----------------------------------|------------------------|--|--|-------------------------------------|------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten(a) US\$ | Nettobetrag(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten(a) US\$ | Nettobetrag(b) US\$ |
| Goldman Sachs International | 185.443 | (149.854) | - | 35.589 | (149.854) | 149.854 | - | - |
| UBS AG | 166.978 | (129.390) | - | 37.588 | (129.390) | 129.390 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 194.799 | (144.100) | - | 50.699 | (144.100) | 144.100 | - | - |
| Insgesamt | 547.220 | (423.344) | - | 123.876 | (423.344) | 423.344 | - | - |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

China Equity (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 1.099.861 | (817.712) |
| Insgesamt | 1.099.861 | (817.712) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Goldman Sachs International | 16.443 | (16.443) | - | - | (20.824) | 16.443 | - | (4.381) |
| UBS AG | 3.274 | (3.274) | - | - | (22.277) | 3.274 | - | (19.003) |
| Westpac Banking Corp | 1.080.144 | (774.611) | - | 305.533 | (774.611) | 774.611 | - | - |
| Insgesamt | 1.099.861 | (794.328) | - | 305.533 | (817.712) | 794.328 | - | (23.384) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

CLO Income

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 2.345.289 | (2.570.754) |
| OTC-Kontrakt | 48.732 | - |
| Insgesamt | 2.394.021 | (2.570.754) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|--------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Goldman Sachs International | 175.123 | (7.243) | - | 167.880 | (7.243) | 7.243 | - | - |
| State Street Bank and Trust Co | 337.885 | (337.885) | - | - | (1.885.494) | 337.885 | - | (1.547.609) |
| UBS AG | 353.824 | (343.797) | - | 10.027 | (343.797) | 343.797 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 1.527.189 | (334.220) | - | 1.192.969 | (334.220) | 334.220 | - | - |
| Insgesamt | 2.394.021 | (1.023.145) | - | 1.370.876 | (2.570.754) | 1.023.145 | - | (1.547.609) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

CLO Income (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten | |
|------------------------|--|--|---|--|
| | US\$ | | US\$ | |
| Devisenterminkontrakte | 3.267.421 | | (989.846) | |
| OTC-Kontrakt | - | | (334.323) | |
| Insgesamt | 3.267.421 | | (1.324.169) | |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|--------------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Goldman Sachs International | 16.221 | (16.221) | - | - | (334.558) | 16.221 | 318.337 | - |
| State Street Bank and Trust Co | - | - | - | - | (760.209) | - | - | (760.209) |
| UBS AG | 1.109.111 | - | - | 1.109.111 | - | - | - | - |
| Westpac Banking Corp | 2.142.089 | (229.402) | - | 1.912.687 | (229.402) | 229.402 | - | - |
| Insgesamt | 3.267.421 | (245.623) | - | 3.021.798 | (1.324.169) | 245.623 | 318.337 | (760.209) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Commodities²

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten | |
|------------------------|--|--|---|--|
| | US\$ | | US\$ | |
| Devisenterminkontrakte | 1.573.388 | | (210.126) | |
| Insgesamt | 1.573.388 | | (210.126) | |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|--------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Standard Chartered Bank | 1.405.179 | (54.235) | - | 1.350.944 | (54.235) | 54.235 | - | - |
| State Street Bank and Trust Co | 42.435 | (14.392) | - | 28.043 | (14.392) | 14.392 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 125.774 | (125.774) | - | - | (141.499) | 125.774 | - | (15.725) |
| Insgesamt | 1.573.388 | (194.401) | - | 1.378.987 | (210.126) | 194.401 | - | (15.725) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Commodities² (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 1.519.496 | (333.046) |
| Insgesamt | 1.519.496 | (333.046) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|--------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Standard Chartered Bank | 1.312.734 | (19.921) | - | 1.292.813 | (19.921) | 19.921 | - | - |
| State Street Bank and Trust Co | 23.465 | (23.465) | - | - | (75.175) | 23.465 | - | (51.710) |
| Westpac Banking Corp | 183.297 | (183.297) | - | - | (237.950) | 183.297 | - | (54.653) |
| Insgesamt | 1.519.496 | (226.683) | - | 1.292.813 | (333.046) | 226.683 | - | (106.363) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | EUR | EUR |
| Devisenterminkontrakte | 12.101.176 | (7.732.130) |
| Insgesamt | 12.101.176 | (7.732.130) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|--|---|---|--------------------------------|--|--|---|--------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten EUR | Erhaltene Sicherheiten ^(a) EUR | Nettobetrag ^(b) EUR | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte EUR | Verpfändete Sicherheiten ^(a) EUR | Nettobetrag ^(b) EUR |
| Goldman Sachs International | 360.537 | (360.537) | - | - | (659.450) | 360.537 | - | (298.913) |
| UBS AG | 601.277 | (601.277) | - | - | (6.754.447) | 601.277 | - | (6.153.170) |
| Westpac Banking Corp | 11.139.362 | (318.233) | - | 10.821.129 | (318.233) | 318.233 | - | - |
| Insgesamt | 12.101.176 | (1.280.047) | - | 10.821.129 | (7.732.130) | 1.280.047 | - | (6.452.083) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | EUR | EUR |
| Devisenterminkontrakte | 36.511.573 | (20.223.334) |
| Insgesamt | 36.511.573 | (20.223.334) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|--|---|---|--------------------------------|--|--|---|--------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten EUR | Erhaltene Sicherheiten ^(a) EUR | Nettobetrag ^(b) EUR | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte EUR | Verpfändete Sicherheiten ^(a) EUR | Nettobetrag ^(b) EUR |
| Goldman Sachs International | 944.612 | (775.751) | - | 168.861 | (775.751) | 775.751 | - | - |
| UBS AG | 3.550.212 | (686.746) | - | 2.863.466 | (686.746) | 686.746 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 32.016.749 | (18.760.837) | - | 13.255.912 | (18.760.837) | 18.760.837 | - | - |
| Insgesamt | 36.511.573 | (20.223.334) | - | 16.288.239 | (20.223.334) | 20.223.334 | - | - |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Developed Market FMP – 20271

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten | |
|------------------------|--|--|---|--|
| | US\$ | | US\$ | |
| Devisenterminkontrakte | 39.869 | | (393) | |
| Insgesamt | 39.869 | | (393) | |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|--------------------------------|--|---|---------------------------------------|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) | | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) | |
| | | | US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | | | US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Goldman Sachs International | 145 | (145) | - | - | (372) | 145 | - | (227) |
| State Street Bank and Trust Co | 20.072 | - | - | 20.072 | - | - | - | - |
| UBS AG | 19.624 | (21) | - | 19.603 | (21) | 21 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 28 | - | - | 28 | - | - | - | - |
| Insgesamt | 39.869 | (166) | - | 39.703 | (393) | 166 | - | (227) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt – Hard Currency

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten | |
|------------------------|--|--|---|--|
| | US\$ | | US\$ | |
| Devisenterminkontrakte | 24.839.124 | | (5.652.118) | |
| Insgesamt | 24.839.124 | | (5.652.118) | |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Citibank NA | 261.317 | (261.317) | - | - | (322.041) | 261.317 | - | (60.724) |
| Deutsche Bank AG | - | - | - | - | (140.358) | - | - | (140.358) |
| Goldman Sachs International | 572.854 | (14.397) | - | 558.457 | (14.397) | 14.397 | - | - |
| HSBC Bank Plc | - | - | - | - | (4.877.290) | - | 4.877.290 | - |
| UBS AG | 20.827.597 | (1.415) | - | 20.826.182 | (1.415) | 1.415 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 3.177.356 | (296.617) | - | 2.880.739 | (296.617) | 296.617 | - | - |
| Insgesamt | 24.839.124 | (573.746) | - | 24.265.378 | (5.652.118) | 573.746 | 4.877.290 | (201.082) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt – Hard Currency (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 12.379.899 | (10.560.096) |
| Insgesamt | 12.379.899 | (10.560.096) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Brown Brothers Harriman | - | - | - | - | (35.687) | - | - | (35.687) |
| Goldman Sachs International | 89.565 | (89.565) | - | - | (765.905) | 89.565 | - | (676.340) |
| HSBC Bank Plc | - | - | - | - | (109.096) | - | - | (109.096) |
| UBS AG | 9.726.057 | (8.242.559) | - | 1.483.498 | (8.242.559) | 8.242.559 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 2.564.277 | (1.406.849) | - | 1.157.428 | (1.406.849) | 1.406.849 | - | - |
| Insgesamt | 12.379.899 | (9.738.973) | - | 2.640.926 | (10.560.096) | 9.738.973 | - | (821.123) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt – Local Currency

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten | |
|------------------------|--|--|---|--|
| | US\$ | | US\$ | |
| Devisenterminkontrakte | 17.116.276 | | (12.281.584) | |
| OTC-Kontrakt | 3.085 | | (2.136.323) | |
| Insgesamt | 17.119.361 | | (14.417.907) | |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|--------------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| | | | | | | | | |
| Barclays Bank Plc | 667.762 | (299.724) | (300.000) | 68.038 | (299.724) | 299.724 | - | - |
| BNP Paribas | - | - | - | - | (49.809) | - | - | (49.809) |
| Citibank NA | 2.231.444 | (1.759.641) | (230.000) | 241.803 | (1.759.641) | 1.759.641 | - | - |
| Deutsche Bank AG | 173.188 | (173.188) | - | - | (349.625) | 173.188 | 100.000 | (76.437) |
| Goldman Sachs International | 2.999.104 | (2.999.104) | - | - | (4.210.723) | 2.999.104 | 1.211.619 | - |
| HSBC Bank Plc | 965.768 | (568.492) | (397.276) | - | (568.492) | 568.492 | - | - |
| JPMorgan Chase Bank | 2.252.252 | (1.514.023) | (738.229) | - | (1.514.023) | 1.514.023 | - | - |
| Morgan Stanley | 630.393 | (470.787) | (120.000) | 39.606 | (470.787) | 470.787 | - | - |
| Standard Chartered Bank | 1.617.740 | (426.665) | (290.000) | 901.075 | (426.665) | 426.665 | - | - |
| State Street Bank and Trust Co | 35.221 | (35.221) | - | - | (602.118) | 35.221 | 530.000 | (36.897) |
| UBS AG | 646.651 | (153) | - | 646.498 | (153) | 153 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 4.899.838 | (4.166.147) | - | 733.691 | (4.166.147) | 4.166.147 | - | - |
| Insgesamt | 17.119.361 | (12.413.145) | (2.075.505) | 2.630.711 | (14.417.907) | 12.413.145 | 1.841.619 | (163.143) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt – Local Currency (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 14.987.459 | (9.665.447) |
| OTC-Kontrakt | 734.076 | (2.207.907) |
| Insgesamt | 15.721.535 | (11.873.354) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|--------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Barclays Bank Plc | 380.673 | (380.673) | - | - | (1.344.347) | 380.673 | - | (963.674) |
| BNP Paribas | 393.015 | (393.015) | - | - | (472.729) | 393.015 | - | (79.714) |
| Brown Brothers Harriman | 34.283 | - | - | 34.283 | - | - | - | - |
| Citibank NA | 2.888.351 | (1.791.727) | - | 1.096.624 | (1.791.727) | 1.791.727 | - | - |
| Deutsche Bank AG | 577.311 | - | - | 577.311 | - | - | - | - |
| Goldman Sachs International | 5.189.853 | (3.515.469) | (1.674.384) | - | (3.515.469) | 3.515.469 | - | - |
| HSBC Bank Plc | 229.243 | (229.243) | - | - | (740.115) | 229.243 | 370.000 | (140.872) |
| JPMorgan Chase Bank | 2.456.371 | (2.456.371) | - | - | (2.956.556) | 2.456.371 | 500.185 | - |
| Morgan Stanley | 1.113.150 | (45.688) | (1.000.000) | 67.462 | (45.688) | 45.688 | - | - |
| Standard Chartered Bank | 740.156 | (198) | - | 739.958 | (198) | 198 | - | - |
| State Street Bank and Trust Co | 91.230 | (91.230) | - | - | (748.662) | 91.230 | 510.000 | (147.432) |
| UBS AG | 1.205.891 | (241.117) | - | 964.774 | (241.117) | 241.117 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 422.008 | (16.746) | - | 405.262 | (16.746) | 16.746 | - | - |
| Insgesamt | 15.721.535 | (9.161.477) | (2.674.384) | 3.885.674 | (11.873.354) | 9.161.477 | 1.380.185 | (1.331.692) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten | |
|------------------------|--|--|---|--|
| | US\$ | | US\$ | |
| Devisenterminkontrakte | 6.637.946 | | (2.075.226) | |
| OTC-Kontrakt | 701 | | (627.829) | |
| Insgesamt | 6.638.647 | | (2.703.055) | |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|--------------------------------|--|---|---------------------------------------|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) | | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) | |
| | | | Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | | | Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Barclays Bank Plc | 230.287 | (111.942) | - | 118.345 | (111.942) | 111.942 | - | - |
| BNP Paribas | 9.403 | (2.582) | - | 6.821 | (2.582) | 2.582 | - | - |
| Brown Brothers Harriman | - | - | - | - | (5.632) | - | - | (5.632) |
| Citibank NA | 316.590 | (316.590) | - | - | (491.860) | 316.590 | 175.270 | - |
| Deutsche Bank AG | 32.343 | - | - | 32.343 | - | - | - | - |
| Goldman Sachs International | 4.403.030 | (1.112.359) | - | 3.290.671 | (1.112.359) | 1.112.359 | - | - |
| HSBC Bank Plc | 203.668 | (108.659) | - | 95.009 | (108.659) | 108.659 | - | - |
| JPMorgan Chase Bank | 165.310 | (165.310) | - | - | (264.497) | 165.310 | 99.187 | - |
| Morgan Stanley | 598.073 | (138.351) | (390.000) | 69.722 | (138.351) | 138.351 | - | - |
| Standard Chartered Bank | 387.662 | (274.429) | - | 113.233 | (274.429) | 274.429 | - | - |
| State Street Bank and Trust Co | 14.466 | (14.466) | - | - | (128.391) | 14.466 | - | (113.925) |
| UBS AG | 92.872 | - | - | 92.872 | - | - | - | - |
| Westpac Banking Corp | 184.943 | (64.353) | - | 120.590 | (64.353) | 64.353 | - | - |
| Insgesamt | 6.638.647 | (2.309.041) | (390.000) | 3.939.606 | (2.703.055) | 2.309.041 | 274.457 | (119.557) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 4.031.358 | (2.058.976) |
| OTC-Kontrakt | 938.323 | (678.507) |
| Insgesamt | 4.969.681 | (2.737.483) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|--------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Barclays Bank Plc | 44.223 | (18.841) | - | 25.382 | (18.841) | 18.841 | - | - |
| Citibank NA | 521.190 | (295.375) | - | 225.815 | (295.375) | 295.375 | - | - |
| Deutsche Bank AG | 102.206 | - | - | 102.206 | - | - | - | - |
| Goldman Sachs International | 1.657.848 | (836.696) | (770.000) | 51.152 | (836.696) | 836.696 | - | - |
| HSBC Bank Plc | 62.182 | (62.182) | - | - | (126.410) | 62.182 | - | (64.228) |
| JPMorgan Chase Bank | 370.316 | (370.316) | - | - | (638.040) | 370.316 | 220.000 | (47.724) |
| Morgan Stanley | 257.955 | (2.938) | (70.000) | 185.017 | (2.938) | 2.938 | - | - |
| Standard Chartered Bank | 3.397 | (3.397) | - | - | (7.546) | 3.397 | - | (4.149) |
| State Street Bank and Trust Co | - | - | - | - | (125.834) | - | - | (125.834) |
| UBS AG | 23.750 | (23.750) | - | - | (492.423) | 23.750 | - | (468.673) |
| Westpac Banking Corp | 1.926.614 | (193.380) | - | 1.733.234 | (193.380) | 193.380 | - | - |
| Insgesamt | 4.969.681 | (1.806.875) | (840.000) | 2.322.806 | (2.737.483) | 1.806.875 | 220.000 | (710.608) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten | |
|------------------------|--|--|---|--|
| | US\$ | | US\$ | |
| Devisenterminkontrakte | 2.325.031 | | (284.238) | |
| OTC-Kontrakt | 57 | | - | |
| Insgesamt | 2.325.088 | | (284.238) | |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|--------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Barclays Bank Plc | 17.042 | (8.742) | - | 8.300 | (8.742) | 8.742 | - | - |
| BNP Paribas | 359.821 | - | - | 359.821 | - | - | - | - |
| Citibank NA | 24.963 | (23.177) | - | 1.786 | (23.177) | 23.177 | - | - |
| Deutsche Bank AG | 2.346 | (2.058) | - | 288 | (2.058) | 2.058 | - | - |
| Goldman Sachs International | 15.848 | (15.848) | - | - | (34.123) | 15.848 | - | (18.275) |
| HSBC Bank Plc | 17.027 | (8.071) | - | 8.956 | (8.071) | 8.071 | - | - |
| JPMorgan Chase Bank | 15.993 | (7.035) | - | 8.958 | (7.035) | 7.035 | - | - |
| Morgan Stanley | 6.332 | (5.193) | - | 1.139 | (5.193) | 5.193 | - | - |
| Standard Chartered Bank | 29.241 | (29.241) | - | - | (159.276) | 29.241 | - | (130.035) |
| State Street Bank and Trust Co | 32.234 | (13.021) | - | 19.213 | (13.021) | 13.021 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 1.804.241 | (23.542) | - | 1.780.699 | (23.542) | 23.542 | - | - |
| Insgesamt | 2.325.088 | (135.928) | - | 2.189.160 | (284.238) | 135.928 | - | (148.310) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 446.879 | (340.697) |
| Insgesamt | 446.879 | (340.697) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|--------------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| | | | | | | | | |
| Barclays Bank Plc | 4.647 | (1.063) | - | 3.584 | (1.063) | 1.063 | - | - |
| BNP Paribas | 112.720 | (3.562) | - | 109.158 | (3.562) | 3.562 | - | - |
| Citibank NA | 28.911 | (28.911) | - | - | (41.714) | 28.911 | - | (12.803) |
| Deutsche Bank AG | 7.148 | (489) | - | 6.659 | (489) | 489 | - | - |
| Goldman Sachs International | 173.055 | (17.275) | - | 155.780 | (17.275) | 17.275 | - | - |
| HSBC Bank Plc | 7.242 | (7.242) | - | - | (10.109) | 7.242 | - | (2.867) |
| JPMorgan Chase Bank | 29.037 | (26.319) | - | 2.718 | (26.319) | 26.319 | - | - |
| Morgan Stanley | 10.524 | (4.456) | - | 6.068 | (4.456) | 4.456 | - | - |
| Standard Chartered Bank | 2.657 | (2.657) | - | - | (204.043) | 2.657 | - | (201.386) |
| State Street Bank and Trust Co | 1.798 | (479) | - | 1.319 | (479) | 479 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 69.140 | (31.188) | - | 37.952 | (31.188) | 31.188 | - | - |
| Insgesamt | 446.879 | (123.641) | - | 323.238 | (340.697) | 123.641 | - | (217.056) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Equity

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 1.272.409 | (787.152) |
| Insgesamt | 1.272.409 | (787.152) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Goldman Sachs International | 220.656 | (110.722) | - | 109.934 | (110.722) | 110.722 | - | - |
| Royal Bank of Canada | 11.819 | (11.819) | - | - | (20.649) | 11.819 | - | (8.830) |
| UBS AG | 370.440 | (79.813) | - | 290.627 | (79.813) | 79.813 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 669.494 | (575.968) | - | 93.526 | (575.968) | 575.968 | - | - |
| Insgesamt | 1.272.409 | (778.322) | - | 494.087 | (787.152) | 778.322 | - | (8.830) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten | |
|------------------------|--|------------------|---|------------------|
| | US\$ | | US\$ | |
| Devisenterminkontrakte | | 1.053.813 | | (666.859) |
| Insgesamt | | 1.053.813 | | (666.859) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Goldman Sachs International | 223.814 | (139.085) | - | 84.729 | (139.085) | 139.085 | - | - |
| Royal Bank of Canada | 567 | (567) | - | - | (2.673) | 567 | - | (2.106) |
| UBS AG | 21.918 | (10.004) | - | 11.914 | (10.004) | 10.004 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 807.514 | (515.097) | - | 292.417 | (515.097) | 515.097 | - | - |
| Insgesamt | 1.053.813 | (664.753) | - | 389.060 | (666.859) | 664.753 | - | (2.106) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Euro Bond Absolute Return

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | EUR | EUR |
| Devisenterminkontrakte | 25.383 | (1.117.757) |
| Insgesamt | 25.383 | (1.117.757) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|--------------------------------|--|---|---|--------------------------------|--|--|---|--------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten EUR | Erhaltene Sicherheiten ^(a) EUR | Nettobetrag ^(b) EUR | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte EUR | Verpfändete Sicherheiten ^(a) EUR | Nettobetrag ^(b) EUR |
| BNP Paribas | 864 | (864) | - | - | (512.453) | 864 | - | (511.589) |
| Goldman Sachs International | - | - | - | - | (30.722) | - | - | (30.722) |
| Standard Chartered Bank | 2.193 | (2.193) | - | - | (32.886) | 2.193 | - | (30.693) |
| State Street Bank and Trust Co | 178 | (178) | - | - | (14.181) | 178 | - | (14.003) |
| Westpac Banking Corp | 22.148 | (22.148) | - | - | (527.515) | 22.148 | - | (505.367) |
| Insgesamt | 25.383 | (25.383) | - | - | (1.117.757) | 25.383 | - | (1.092.374) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Euro Bond Absolute Return (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | EUR | EUR |
| Devisenterminkontrakte | 39.745 | (1.032.074) |
| Insgesamt | 39.745 | (1.032.074) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|--------------------------------|--|---|---|--------------------------------|--|--|---|--------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten EUR | Erhaltene Sicherheiten ^(a) EUR | Nettobetrag ^(b) EUR | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte EUR | Verpfändete Sicherheiten ^(a) EUR | Nettobetrag ^(b) EUR |
| Goldman Sachs International | 608 | (608) | - | - | (10.898) | 608 | - | (10.290) |
| Standard Chartered Bank | 5.615 | (5.615) | - | - | (29.576) | 5.615 | - | (23.961) |
| State Street Bank and Trust Co | 17.588 | (5.247) | - | 12.341 | (5.247) | 5.247 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 15.934 | (15.934) | - | - | (986.353) | 15.934 | - | (970.419) |
| Insgesamt | 39.745 | (27.404) | - | 12.341 | (1.032.074) | 27.404 | - | (1.004.670) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

European High Yield Bond

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | EUR | EUR |
| Devisenterminkontrakte | 643.091 | (1.281.452) |
| OTC-Kontrakt | 18.355 | - |
| Insgesamt | 661.446 | (1.281.452) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|---|--|--|-----------------------------------|---|---|--|-----------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten EUR | Erhaltene Sicherheiten ^(a) EUR | Nettobetrag ^(b) EUR | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte EUR | Verpfändete Sicherheiten ^(a) EUR | Nettobetrag ^(b) EUR |
| Goldman Sachs International | 23.074 | (19.823) | - | 3.251 | (19.823) | 19.823 | - | - |
| UBS AG | 596.607 | (596.607) | - | - | (1.014.198) | 596.607 | - | (417.591) |
| Westpac Banking Corp | 41.765 | (41.765) | - | - | (247.431) | 41.765 | - | (205.666) |
| Insgesamt | 661.446 | (658.195) | - | 3.251 | (1.281.452) | 658.195 | - | (623.257) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

European High Yield Bond (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | EUR | EUR |
| Devisenterminkontrakte | 1.258.544 | (3.113.019) |
| Insgesamt | 1.258.544 | (3.113.019) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|---|--|--|-----------------------------------|---|---|--|-----------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten EUR | Erhaltene Sicherheiten ^(a) EUR | Nettobetrag ^(b) EUR | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte EUR | Verpfändete Sicherheiten ^(a) EUR | Nettobetrag ^(b) EUR |
| Goldman Sachs International | 20.066 | (20.066) | - | - | (39.074) | 20.066 | - | (19.008) |
| UBS AG | 35.438 | (16.930) | - | 18.508 | (16.930) | 16.930 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 1.203.040 | (1.203.040) | - | - | (3.057.015) | 1.203.040 | - | (1.853.975) |
| Insgesamt | 1.258.544 | (1.240.036) | - | 18.508 | (3.113.019) | 1.240.036 | - | (1.872.983) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Event Driven²

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten | |
|------------------------|--|--|---|--|
| | US\$ | | US\$ | |
| Devisenterminkontrakte | 4.057.943 | | (155.365) | |
| OTC-Kontrakt | 959.529 | | - | |
| Insgesamt | 5.017.472 | | (155.365) | |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|--------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Morgan Stanley | 959.529 | - | - | 959.529 | - | - | - | - |
| State Street Bank and Trust Co | 3.752.797 | (6) | - | 3.752.791 | (6) | 6 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 305.146 | (155.359) | - | 149.787 | (155.359) | 155.359 | - | - |
| Insgesamt | 5.017.472 | (155.365) | - | 4.862.107 | (155.365) | 155.365 | - | - |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Event Driven² (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 918.069 | (18.616) |
| OTC-Kontrakt | 18.364 | - |
| Insgesamt | 936.433 | (18.616) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|----------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Morgan Stanley | 18.364 | - | - | 18.364 | - | - | - | - |
| Westpac Banking Corp | 918.069 | (18.616) | - | 899.453 | (18.616) | 18.616 | - | - |
| Insgesamt | 936.433 | (18.616) | - | 917.817 | (18.616) | 18.616 | - | - |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Bond

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten | |
|------------------------|--|--|---|--|
| | US\$ | | US\$ | |
| Devisenterminkontrakte | 3.337.129 | | (3.195.228) | |
| Insgesamt | 3.337.129 | | (3.195.228) | |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|------------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| BNP Paribas | 460.011 | (460.011) | - | - | (688.009) | 460.011 | - | (227.998) |
| Canadian Imperial Bank of Commerce | 28.969 | - | - | 28.969 | - | - | - | - |
| Citibank NA | - | - | - | - | (498) | - | - | (498) |
| Deutsche Bank AG | 39.583 | (18.794) | - | 20.789 | (18.794) | 18.794 | - | - |
| Goldman Sachs International | 840.078 | (800.823) | - | 39.255 | (800.823) | 800.823 | - | - |
| Royal Bank of Canada | 327.646 | (21.429) | - | 306.217 | (21.429) | 21.429 | - | - |
| Société Générale | 207.886 | (207.886) | - | - | (271.737) | 207.886 | - | (63.851) |
| Standard Chartered Bank | 445.291 | (322.164) | - | 123.127 | (322.164) | 322.164 | - | - |
| State Street Bank and Trust Co | 430.936 | (417.433) | - | 13.503 | (417.433) | 417.433 | - | - |
| UBS AG | 291.560 | (291.560) | - | - | (456.074) | 291.560 | - | (164.514) |
| Westpac Banking Corp | 265.169 | (198.267) | - | 66.902 | (198.267) | 198.267 | - | - |
| Insgesamt | 3.337.129 | (2.738.367) | - | 598.762 | (3.195.228) | 2.738.367 | - | (456.861) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Bond (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten | |
|------------------------|--|--|---|--|
| | US\$ | | US\$ | |
| Devisenterminkontrakte | 2.638.428 | | (1.908.377) | |
| Insgesamt | 2.638.428 | | (1.908.377) | |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | | |
|--------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|--|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | |
| BNP Paribas | 442.935 | (217.047) | - | 225.888 | (217.047) | 217.047 | - | - | |
| Goldman Sachs International | 120.460 | (120.460) | - | - | (615.311) | 120.460 | 280.000 | (214.851) | |
| Royal Bank of Canada | 30.889 | (30.889) | - | - | (55.928) | 30.889 | - | (25.039) | |
| Société Générale | 28.962 | (28.962) | - | - | (161.628) | 28.962 | - | (132.666) | |
| Standard Chartered Bank | 1.202.093 | (124.265) | - | 1.077.828 | (124.265) | 124.265 | - | - | |
| State Street Bank and Trust Co | 203.836 | (61.874) | - | 141.962 | (61.874) | 61.874 | - | - | |
| UBS AG | 381.622 | (381.622) | - | - | (528.995) | 381.622 | - | (147.373) | |
| Westpac Banking Corp | 227.631 | (143.329) | - | 84.302 | (143.329) | 143.329 | - | - | |
| Insgesamt | 2.638.428 | (1.108.448) | - | 1.529.980 | (1.908.377) | 1.108.448 | 280.000 | (519.929) | |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Diversified Income FMP – 2024

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 281.732 | - |
| Insgesamt | 281.732 | - |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|----------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| UBS AG | 181.693 | - | - | 181.693 | - | - | - | - |
| Westpac Banking Corp | 100.039 | - | - | 100.039 | - | - | - | - |
| Insgesamt | 281.732 | - | - | 281.732 | - | - | - | - |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Diversified Income FMP – 2024 (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 523.987 | (417) |
| Insgesamt | 523.987 | (417) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|--------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| State Street Bank and Trust Co | 34 | - | - | 34 | - | - | - | - |
| UBS AG | 3.888 | - | - | 3.888 | - | - | - | - |
| Westpac Banking Corp | 520.065 | (417) | - | 519.648 | (417) | 417 | - | - |
| Insgesamt | 523.987 | (417) | - | 523.570 | (417) | 417 | - | - |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Equity Megatrends

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 444 | - |
| Insgesamt | 444 | - |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|----------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Westpac Banking Corp | 444 | - | - | 444 | - | - | - | - |
| Insgesamt | 444 | - | - | 444 | - | - | - | - |

31. Dezember 2022

Keine zur Saldierung verfügbaren Vermögenswerte und Verbindlichkeiten aus OTC-Derivaten und Wertpapierleihgeschäften.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Flexible Credit Income

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten | |
|------------------------|--|--|---|--|
| | US\$ | | US\$ | |
| Devisenterminkontrakte | 8.130.820 | | (3.447.658) | |
| OTC-Kontrakt | 268.263 | | - | |
| Insgesamt | 8.399.083 | | (3.447.658) | |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|--------------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Goldman Sachs International | 112.698 | (112.698) | - | - | (117.706) | 112.698 | - | (5.008) |
| JPMorgan Chase Bank | 268.263 | - | (200.000) | 68.263 | - | - | - | - |
| Royal Bank of Canada | 214.612 | (214.612) | - | - | (562.562) | 214.612 | - | (347.950) |
| State Street Bank and Trust Co | 3.658.224 | (2.539.881) | - | 1.118.343 | (2.539.881) | 2.539.881 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 4.145.286 | (227.509) | - | 3.917.777 | (227.509) | 227.509 | - | - |
| Insgesamt | 8.399.083 | (3.094.700) | (200.000) | 5.104.383 | (3.447.658) | 3.094.700 | - | (352.958) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Flexible Credit Income (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 29.033.515 | (10.857.921) |
| OTC-Kontrakt | - | (632.100) |
| Insgesamt | 29.033.515 | (11.490.021) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|--------------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Goldman Sachs International | 521.466 | (521.466) | - | - | (657.911) | 521.466 | - | (136.445) |
| JPMorgan Chase Bank | 154.429 | (154.429) | - | - | (604.889) | 154.429 | 760.000 | 309.540 |
| State Street Bank and Trust Co | 25.713.338 | (5.911.810) | - | 19.801.528 | (5.911.810) | 5.911.810 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 2.644.282 | (2.644.282) | - | - | (4.315.411) | 2.644.282 | - | (1.671.129) |
| Insgesamt | 29.033.515 | (9.231.987) | - | 19.801.528 | (11.490.021) | 9.231.987 | 760.000 | (1.498.034) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global High Yield SDG Engagement

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten | |
|------------------------|--|--|---|--|
| | US\$ | | US\$ | |
| Devisenterminkontrakte | 11.935.674 | | (6.738.234) | |
| Insgesamt | 11.935.674 | | (6.738.234) | |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Goldman Sachs International | 131.470 | (131.470) | - | - | (166.547) | 131.470 | - | (35.077) |
| UBS AG | 3.486.572 | (3.486.572) | - | - | (5.647.348) | 3.486.572 | - | (2.160.776) |
| Westpac Banking Corp | 8.317.632 | (924.339) | - | 7.393.293 | (924.339) | 924.339 | - | - |
| Insgesamt | 11.935.674 | (4.542.381) | - | 7.393.293 | (6.738.234) | 4.542.381 | - | (2.195.853) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten | |
|------------------------|--|--|---|--|
| | US\$ | | US\$ | |
| Devisenterminkontrakte | 12.873.530 | | (9.426.254) | |
| OTC-Kontrakt | 13.411 | | - | |
| Insgesamt | 12.886.941 | | (9.426.254) | |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Goldman Sachs International | 43.567 | (43.567) | - | - | (84.265) | 43.567 | - | (40.698) |
| UBS AG | 503.272 | (74) | - | 503.198 | (74) | 74 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 12.340.102 | (9.341.915) | - | 2.998.187 | (9.341.915) | 9.341.915 | - | - |
| Insgesamt | 12.886.941 | (9.385.556) | - | 3.501.385 | (9.426.254) | 9.385.556 | - | (40.698) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global High Yield Sustainable Action*

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 7.620 | (358.029) |
| Insgesamt | 7.620 | (358.029) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|--------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| State Street Bank and Trust Co | - | - | - | - | (356.484) | - | - | (356.484) |
| Westpac Banking Corp | 7.620 | (1.545) | - | 6.075 | (1.545) | 1.545 | - | - |
| Insgesamt | 7.620 | (1.545) | - | 6.075 | (358.029) | 1.545 | - | (356.484) |

* Das Portfolio wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Investment Grade Credit

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 1.115 | (1.107.450) |
| Insgesamt | 1.115 | (1.107.450) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|--------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Standard Chartered Bank | 1.101 | (191) | - | 910 | (191) | 191 | - | - |
| State Street Bank and Trust Co | - | - | - | - | (314.049) | - | - | (314.049) |
| UBS AG | - | - | - | - | (63.314) | - | - | (63.314) |
| Westpac Banking Corp | 14 | (14) | - | - | (729.896) | 14 | - | (729.882) |
| Insgesamt | 1.115 | (205) | - | 910 | (1.107.450) | 205 | - | (1.107.245) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Investment Grade Credit (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 16.124 | (1.642.819) |
| Insgesamt | 16.124 | (1.642.819) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|--------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| JPMorgan Chase Bank | 12.361 | (1.985) | - | 10.376 | (1.985) | 1.985 | - | - |
| State Street Bank and Trust Co | - | - | - | - | (1.350.854) | - | - | (1.350.854) |
| UBS AG | - | - | - | - | (289.980) | - | - | (289.980) |
| Westpac Banking Corp | 3.763 | - | - | 3.763 | - | - | - | - |
| Insgesamt | 16.124 | (1.985) | - | 14.139 | (1.642.819) | 1.985 | - | (1.640.834) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Opportunistic Bond

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 4.673.609 | (6.577.836) |
| Insgesamt | 4.673.609 | (6.577.836) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Vermögenswerte

Verbindlichkeiten

| Gegenpartei | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten | Erhaltene Sicherheiten ^(a) | Nettobetrag ^(b) | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte | Verpfändete Sicherheiten ^(a) | Nettobetrag ^(b) |
|--------------------------------|--|---|---------------------------------------|----------------------------|--|--|---|----------------------------|
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ |
| BNP Paribas | 978.221 | (978.221) | - | - | (1.289.214) | 978.221 | - | (310.993) |
| Citibank NA | - | - | - | - | (925) | - | - | (925) |
| Deutsche Bank AG | 10.673 | (10.673) | - | - | (139.651) | 10.673 | - | (128.978) |
| Goldman Sachs International | 1.615.491 | (1.324.027) | - | 291.464 | (1.324.027) | 1.324.027 | - | - |
| JPMorgan Chase Bank | 45.426 | - | - | 45.426 | - | - | - | - |
| Royal Bank of Canada | 15.527 | (15.527) | - | - | (148.425) | 15.527 | - | (132.898) |
| Société Générale | 78.724 | (78.724) | - | - | (153.133) | 78.724 | - | (74.409) |
| Standard Chartered Bank | 308.710 | (308.710) | - | - | (541.519) | 308.710 | - | (232.809) |
| State Street Bank and Trust Co | 660.093 | (660.093) | - | - | (1.678.714) | 660.093 | - | (1.018.621) |
| UBS AG | 521.044 | (521.044) | - | - | (809.174) | 521.044 | - | (288.130) |
| Westpac Banking Corp | 439.700 | (439.700) | - | - | (493.054) | 439.700 | - | (53.354) |
| Insgesamt | 4.673.609 | (4.336.719) | - | 336.890 | (6.577.836) | 4.336.719 | - | (2.241.117) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Opportunistic Bond (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 2.069.747 | (4.857.533) |
| Insgesamt | 2.069.747 | (4.857.533) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | | |
|--------------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|--|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | |
| BNP Paribas | 356.289 | (352.886) | - | 3.403 | (352.886) | 352.886 | - | - | |
| Deutsche Bank AG | 7.783 | (7.783) | - | - | (14.157) | 7.783 | - | (6.374) | |
| Goldman Sachs International | 135.105 | (135.105) | - | - | (793.090) | 135.105 | - | (657.985) | |
| JPMorgan Chase Bank | 622 | - | - | 622 | - | - | - | - | |
| Royal Bank of Canada | 47.862 | (95) | - | 47.767 | (95) | 95 | - | - | |
| Standard Chartered Bank | 265.077 | (265.077) | - | - | (268.202) | 265.077 | - | (3.125) | |
| State Street Bank and Trust Co | 172.765 | (94.768) | - | 77.997 | (94.768) | 94.768 | - | - | |
| UBS AG | 169.137 | (169.137) | - | - | (2.748.144) | 169.137 | - | (2.579.007) | |
| Westpac Banking Corp | 915.107 | (586.191) | - | 328.916 | (586.191) | 586.191 | - | - | |
| Insgesamt | 2.069.747 | (1.611.042) | - | 458.705 | (4.857.533) | 1.611.042 | - | (3.246.491) | |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Real Estate Securities

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 422.478 | (250.684) |
| Insgesamt | 422.478 | (250.684) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Goldman Sachs International | 10.067 | (10.067) | - | - | (13.728) | 10.067 | - | (3.661) |
| UBS AG | 211.249 | (7.649) | - | 203.600 | (7.649) | 7.649 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 201.162 | (201.162) | - | - | (229.307) | 201.162 | - | (28.145) |
| Insgesamt | 422.478 | (218.878) | - | 203.600 | (250.684) | 218.878 | - | (31.806) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Real Estate Securities (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 866.015 | (147.763) |
| Insgesamt | 866.015 | (147.763) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Goldman Sachs International | 41.770 | (37.969) | - | 3.801 | (37.969) | 37.969 | - | - |
| UBS AG | 8.091 | (1.801) | - | 6.290 | (1.801) | 1.801 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 816.154 | (107.993) | - | 708.161 | (107.993) | 107.993 | - | - |
| Insgesamt | 866.015 | (147.763) | - | 718.252 | (147.763) | 147.763 | - | - |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Sustainable Value

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 66.448 | (46.897) |
| Insgesamt | 66.448 | (46.897) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Goldman Sachs International | 512 | (454) | - | 58 | (454) | 454 | - | - |
| UBS AG | 32.773 | (22.275) | - | 10.498 | (22.275) | 22.275 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 33.163 | (24.168) | - | 8.995 | (24.168) | 24.168 | - | - |
| Insgesamt | 66.448 | (46.897) | - | 19.551 | (46.897) | 46.897 | - | - |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Sustainable Value (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 125.312 | (90.456) |
| Insgesamt | 125.312 | (90.456) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Goldman Sachs International | 1.555 | (1.312) | - | 243 | (1.312) | 1.312 | - | - |
| UBS AG | 316 | - | - | 316 | - | - | - | - |
| Westpac Banking Corp | 123.441 | (89.144) | - | 34.297 | (89.144) | 89.144 | - | - |
| Insgesamt | 125.312 | (90.456) | - | 34.856 | (90.456) | 90.456 | - | - |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten | |
|------------------------|--|--|---|--|
| | US\$ | | US\$ | |
| Devisenterminkontrakte | 40.709.223 | | (15.391.406) | |
| OTC-Kontrakt | - | | (51.928) | |
| Insgesamt | 40.709.223 | | (15.443.334) | |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Goldman Sachs International | 8.518.424 | (1.130.109) | - | 7.388.315 | (1.130.109) | 1.130.109 | - | - |
| JPMorgan Chase Bank | - | - | - | - | (51.928) | - | - | (51.928) |
| UBS AG | 18.392.576 | (8.661.964) | - | 9.730.612 | (8.661.964) | 8.661.964 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 13.798.223 | (5.599.333) | - | 8.198.890 | (5.599.333) | 5.599.333 | - | - |
| Insgesamt | 40.709.223 | (15.391.406) | - | 25.317.817 | (15.443.334) | 15.391.406 | - | (51.928) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 55.707.544 | (25.192.706) |
| OTC-Kontrakt | - | (404.963) |
| Insgesamt | 55.707.544 | (25.597.669) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Goldman Sachs International | 8.246.368 | (1.647.022) | - | 6.599.346 | (1.647.022) | 1.647.022 | - | - |
| JPMorgan Chase Bank | - | - | - | - | (404.963) | - | 300.000 | (104.963) |
| UBS AG | 9.516.420 | (3.564.399) | - | 5.952.021 | (3.564.399) | 3.564.399 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 37.944.756 | (19.981.285) | - | 17.963.471 | (19.981.285) | 19.981.285 | - | - |
| Insgesamt | 55.707.544 | (25.192.706) | - | 30.514.838 | (25.597.669) | 25.192.706 | 300.000 | (104.963) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

InnovAsia 5G

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 299.135 | (60.136) |
| Insgesamt | 299.135 | (60.136) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|--------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Standard Chartered Bank | 6.569 | (5.960) | - | 609 | (5.960) | 5.960 | - | - |
| State Street Bank and Trust Co | 38.240 | (1.950) | - | 36.290 | (1.950) | 1.950 | - | - |
| UBS AG | 207.008 | (14.058) | - | 192.950 | (14.058) | 14.058 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 47.318 | (38.168) | - | 9.150 | (38.168) | 38.168 | - | - |
| Insgesamt | 299.135 | (60.136) | - | 238.999 | (60.136) | 60.136 | - | - |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

InnovAsia 5G (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 453.339 | (78.732) |
| Insgesamt | 453.339 | (78.732) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|--------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| JPMorgan Chase Bank | 4.236 | (4.236) | - | - | (16.573) | 4.236 | - | (12.337) |
| Standard Chartered Bank | 16.275 | (3.158) | - | 13.117 | (3.158) | 3.158 | - | - |
| State Street Bank and Trust Co | - | - | - | - | (2.383) | - | - | (2.383) |
| UBS AG | 2.818 | (2.818) | - | - | (9.094) | 2.818 | - | (6.276) |
| Westpac Banking Corp | 430.010 | (47.524) | - | 382.486 | (47.524) | 47.524 | - | - |
| Insgesamt | 453.339 | (57.736) | - | 395.603 | (78.732) | 57.736 | - | (20.996) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Japanischen Aktienengagement

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten | |
|------------------------|--|--|---|--|
| | JPY | | JPY | |
| Devisenterminkontrakte | 128.484.079 | | (42.002.252) | |
| Insgesamt | 128.484.079 | | (42.002.252) | |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|--------------------------------|--|---|---|--------------------------------|--|--|---|--------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge JPY | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten JPY | Erhaltene Sicherheiten ^(a) JPY | Nettobetrag ^(b) JPY | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge JPY | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte JPY | Verpfändete Sicherheiten ^(a) JPY | Nettobetrag ^(b) JPY |
| Brown Brothers Harriman | 69.722 | (23.619) | - | 46.103 | (23.619) | 23.619 | - | - |
| Standard Chartered Bank | 2.860.241 | (1.032.189) | - | 1.828.052 | (1.032.189) | 1.032.189 | - | - |
| State Street Bank and Trust Co | 3.449.741 | (3.449.741) | - | - | (39.519.881) | 3.449.741 | - | (36.070.140) |
| Westpac Banking Corp | 122.104.375 | (1.426.563) | - | 120.677.812 | (1.426.563) | 1.426.563 | - | - |
| Insgesamt | 128.484.079 | (5.932.112) | - | 122.551.967 | (42.002.252) | 5.932.112 | - | (36.070.140) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Japan Equity Engagement (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten | |
|------------------------|--|--|---|--|
| | JPY | | JPY | |
| Devisenterminkontrakte | 44.531.344 | | (141.215.249) | |
| Insgesamt | 44.531.344 | | (141.215.249) | |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|--------------------------------|--|---|---|--------------------------------|--|--|---|--------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge JPY | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten JPY | Erhaltene Sicherheiten ^(a) JPY | Nettobetrag ^(b) JPY | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge JPY | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte JPY | Verpfändete Sicherheiten ^(a) JPY | Nettobetrag ^(b) JPY |
| Standard Chartered Bank | 9.748.767 | (9.748.767) | - | - | (16.417.996) | 9.748.767 | - | (6.669.229) |
| State Street Bank and Trust Co | 14.707.131 | (14.707.131) | - | - | (52.892.460) | 14.707.131 | - | (38.185.329) |
| Westpac Banking Corp | 20.075.446 | (20.075.446) | - | - | (71.904.793) | 20.075.446 | - | (51.829.347) |
| Insgesamt | 44.531.344 | (44.531.344) | - | - | (141.215.249) | 44.531.344 | - | (96.683.905) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Macro Opportunities FX

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | EUR | EUR |
| Devisenterminkontrakte | 4.627.295 | (4.613.695) |
| Insgesamt | 4.627.295 | (4.613.695) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|--------------------------------|--|---|---|--------------------------------|--|--|---|--------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten EUR | Erhaltene Sicherheiten ^(a) EUR | Nettobetrag ^(b) EUR | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte EUR | Verpfändete Sicherheiten ^(a) EUR | Nettobetrag ^(b) EUR |
| BNP Paribas | 915.663 | (915.663) | - | - | (1.216.937) | 915.663 | - | (301.274) |
| Citibank NA | - | - | - | - | (286) | - | - | (286) |
| Deutsche Bank AG | 565.493 | (187.451) | - | 378.042 | (187.451) | 187.451 | - | - |
| Goldman Sachs International | 1.337.289 | (852.517) | - | 484.772 | (852.517) | 852.517 | - | - |
| Standard Chartered Bank | 221.272 | (221.272) | - | - | (612.890) | 221.272 | - | (391.618) |
| State Street Bank and Trust Co | 663.217 | (663.217) | - | - | (697.543) | 663.217 | - | (34.326) |
| UBS AG | 478.535 | (478.535) | - | - | (592.588) | 478.535 | - | (114.053) |
| Westpac Banking Corp | 445.826 | (445.826) | - | - | (453.483) | 445.826 | - | (7.657) |
| Insgesamt | 4.627.295 | (3.764.481) | - | 862.814 | (4.613.695) | 3.764.481 | - | (849.214) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Macro Opportunities FX (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | EUR | EUR |
| Devisenterminkontrakte | 3.617.207 | (4.428.576) |
| Insgesamt | 3.617.207 | (4.428.576) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|--------------------------------|--|---|---|--------------------------------|--|--|---|--------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten EUR | Erhaltene Sicherheiten ^(a) EUR | Nettobetrag ^(b) EUR | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte EUR | Verpfändete Sicherheiten ^(a) EUR | Nettobetrag ^(b) EUR |
| BNP Paribas | 1.253.848 | (1.224.102) | - | 29.746 | (1.224.102) | 1.224.102 | - | - |
| Deutsche Bank AG | - | - | - | - | (702.163) | - | - | (702.163) |
| Goldman Sachs International | 346.789 | (346.789) | - | - | (1.143.875) | 346.789 | - | (797.086) |
| Standard Chartered Bank | 490.351 | (391.878) | - | 98.473 | (391.878) | 391.878 | - | - |
| State Street Bank and Trust Co | 415.549 | (168.777) | - | 246.772 | (168.777) | 168.777 | - | - |
| UBS AG | 382.277 | (298.409) | - | 83.868 | (298.409) | 298.409 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 728.393 | (499.372) | - | 229.021 | (499.372) | 499.372 | - | - |
| Insgesamt | 3.617.207 | (2.929.327) | - | 687.880 | (4.428.576) | 2.929.327 | - | (1.499.249) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Multi-Asset Income*

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 160.435 | (584.335) |
| Insgesamt | 160.435 | (584.335) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|--------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| BNP Paribas | 40.724 | (39.912) | - | 812 | (39.912) | 39.912 | - | - |
| Brown Brothers Harriman | 11 | - | - | 11 | - | - | - | - |
| Deutsche Bank AG | - | - | - | - | (21.485) | - | - | (21.485) |
| Goldman Sachs International | 19.681 | (19.681) | - | - | (47.002) | 19.681 | - | (27.321) |
| JPMorgan Chase Bank | 18 | - | - | 18 | - | - | - | - |
| Royal Bank of Canada | 68 | - | - | 68 | - | - | - | - |
| Standard Chartered Bank | 51.221 | (10.722) | - | 40.499 | (10.722) | 10.722 | - | - |
| State Street Bank and Trust Co | 14.764 | (14.764) | - | - | (454.800) | 14.764 | - | (440.036) |
| UBS AG | 33.175 | (10.351) | - | 22.824 | (10.351) | 10.351 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 773 | (63) | - | 710 | (63) | 63 | - | - |
| Insgesamt | 160.435 | (95.493) | - | 64.942 | (584.335) | 95.493 | - | (488.842) |

* Das Portfolio wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Next Generation Mobility

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 20.789 | (10.365) |
| Insgesamt | 20.789 | (10.365) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|--|---|---------------------------------------|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) | | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) | |
| | | | Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | | | Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Goldman Sachs International | 510 | (510) | - | - | (820) | 510 | - | (310) |
| UBS AG | 10.281 | (55) | - | 10.226 | (55) | 55 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 9.998 | (9.490) | - | 508 | (9.490) | 9.490 | - | - |
| Insgesamt | 20.789 | (10.055) | - | 10.734 | (10.365) | 10.055 | - | (310) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Next Generation Mobility (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 294.328 | (213.661) |
| Insgesamt | 294.328 | (213.661) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Goldman Sachs International | 9.006 | (9.006) | - | - | (10.518) | 9.006 | - | (1.512) |
| UBS AG | 80 | (2) | - | 78 | (2) | 2 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 285.242 | (203.141) | - | 82.101 | (203.141) | 203.141 | - | - |
| Insgesamt | 294.328 | (212.149) | - | 82.179 | (213.661) | 212.149 | - | (1.512) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Responsible Asian Debt – Hard Currency

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten | |
|------------------------|--|--|---|--|
| | US\$ | | US\$ | |
| Devisenterminkontrakte | 127.055 | | (135.330) | |
| OTC-Kontrakt | 167 | | - | |
| Insgesamt | 127.222 | | (135.330) | |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| | | | | | | | | |
| BNP Paribas | 15.028 | - | - | 15.028 | - | - | - | - |
| Citibank NA | 28.364 | (10.417) | - | 17.947 | (10.417) | 10.417 | - | - |
| Goldman Sachs International | 25.702 | - | - | 25.702 | - | - | - | - |
| JPMorgan Chase Bank | 25.414 | (19.642) | - | 5.772 | (19.642) | 19.642 | - | - |
| Morgan Stanley | 3.429 | (3.429) | - | - | (53.568) | 3.429 | - | (50.139) |
| Standard Chartered Bank | 22.248 | (22.248) | - | - | (51.167) | 22.248 | - | (28.919) |
| UBS AG | 7.037 | (536) | - | 6.501 | (536) | 536 | - | - |
| Insgesamt | 127.222 | (56.272) | - | 70.950 | (135.330) | 56.272 | - | (79.058) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Responsible Asian Debt – Hard Currency (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 34.382 | (84.733) |
| Insgesamt | 34.382 | (84.733) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| BNP Paribas | 3.444 | (1) | - | 3.443 | (1) | 1 | - | - |
| Citibank NA | 2.050 | (2.050) | - | - | (11.771) | 2.050 | - | (9.721) |
| Goldman Sachs International | 10.822 | - | - | 10.822 | - | - | - | - |
| JPMorgan Chase Bank | 17.674 | (17.674) | - | - | (29.242) | 17.674 | - | (11.568) |
| Morgan Stanley | 392 | (392) | - | - | (864) | 392 | - | (472) |
| Standard Chartered Bank | - | - | - | - | (42.855) | - | - | (42.855) |
| Insgesamt | 34.382 | (20.117) | - | 14.265 | (84.733) | 20.117 | - | (64.616) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten | |
|------------------------|--|--|---|--|
| | US\$ | | US\$ | |
| Devisenterminkontrakte | 64.552.046 | | (9.131.675) | |
| Insgesamt | 64.552.046 | | (9.131.675) | |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|--|---|---------------------------------------|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) | | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) | |
| | | | US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | | | US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Citibank NA | 106.705 | (106.705) | - | - | (147.411) | 106.705 | - | (40.706) |
| Goldman Sachs International | 36.534.923 | - | - | 36.534.923 | - | - | - | - |
| HSBC Bank Plc | 36.950 | (36.950) | - | - | (3.382.906) | 36.950 | 3.345.956 | - |
| Royal Bank of Canada | 18.468.179 | - | - | 18.468.179 | - | - | - | - |
| UBS AG | 8.810.283 | (4.951.663) | - | 3.858.620 | (4.951.663) | 4.951.663 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 595.006 | (595.006) | - | - | (649.695) | 595.006 | - | (54.689) |
| Insgesamt | 64.552.046 | (5.690.324) | - | 58.861.722 | (9.131.675) | 5.690.324 | 3.345.956 | (95.395) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten | |
|------------------------|--|--|---|--|
| | US\$ | | US\$ | |
| Devisenterminkontrakte | 46.700.064 | | (23.986.773) | |
| Insgesamt | 46.700.064 | | (23.986.773) | |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|--|---|---------------------------------------|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) | | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) | |
| | | | US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | | | US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Citibank NA | - | - | - | - | (5.698.738) | - | - | (5.698.738) |
| Goldman Sachs International | 168.124 | (168.124) | - | - | (370.635) | 168.124 | - | (202.511) |
| Royal Bank of Canada | 210 | - | - | 210 | - | - | - | - |
| UBS AG | 45.553.017 | (16.806.182) | - | 28.746.835 | (16.806.182) | 16.806.182 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 978.713 | (978.713) | - | - | (1.111.218) | 978.713 | - | (132.505) |
| Insgesamt | 46.700.064 | (17.953.019) | - | 28.747.045 | (23.986.773) | 17.953.019 | - | (6.033.754) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten | |
|------------------------|--|--|---|--|
| | US\$ | | US\$ | |
| Devisenterminkontrakte | 15.254.920 | | (3.114.085) | |
| Insgesamt | 15.254.920 | | (3.114.085) | |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|--|---|---------------------------------------|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) | | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) | |
| | | | US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | | | US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Goldman Sachs International | 134.884 | (69.533) | - | 65.351 | (69.533) | 69.533 | - | - |
| UBS AG | 6.142.919 | (1.376.770) | - | 4.766.149 | (1.376.770) | 1.376.770 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 8.977.117 | (1.667.782) | - | 7.309.335 | (1.667.782) | 1.667.782 | - | - |
| Insgesamt | 15.254.920 | (3.114.085) | - | 12.140.835 | (3.114.085) | 3.114.085 | - | - |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten | |
|------------------------|--|--|---|--|
| | US\$ | | US\$ | |
| Devisenterminkontrakte | 23.012.144 | | (5.286.451) | |
| Insgesamt | 23.012.144 | | (5.286.451) | |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|--|---|---------------------------------------|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) | | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) | |
| | | | US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | | | US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Goldman Sachs International | 150.807 | (31.799) | - | 119.008 | (31.799) | 31.799 | - | - |
| UBS AG | 1.077.478 | (513.291) | - | 564.187 | (513.291) | 513.291 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 21.783.859 | (4.741.361) | - | 17.042.498 | (4.741.361) | 4.741.361 | - | - |
| Insgesamt | 23.012.144 | (5.286.451) | - | 17.725.693 | (5.286.451) | 5.286.451 | - | - |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Strategic Income

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US\$ | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US\$ |
|------------------------|--|---|
| Devisenterminkontrakte | 20.251.351 | (5.513.615) |
| OTC-Kontrakt | 461.585 | - |
| OTC Swaptions | 15.122 | - |
| Insgesamt | 20.728.058 | (5.513.615) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Barclays Bank Plc | 50.289 | (14.141) | - | 36.148 | (14.141) | 14.141 | - | - |
| Citibank NA | 231.474 | (61.555) | - | 169.919 | (61.555) | 61.555 | - | - |
| Goldman Sachs International | 2.664.490 | (1.338.617) | (520.000) | 805.873 | (1.338.617) | 1.338.617 | - | - |
| HSBC Bank Plc | 13.642 | (3.157) | - | 10.485 | (3.157) | 3.157 | - | - |
| JPMorgan Chase Bank | 38.574 | (8.209) | - | 30.365 | (8.209) | 8.209 | - | - |
| Morgan Stanley | 38.972 | (8.589) | - | 30.383 | (8.589) | 8.589 | - | - |
| Royal Bank of Canada | 109.028 | (109.028) | - | - | (2.607.384) | 109.028 | - | (2.498.356) |
| Standard Chartered Bank | 20.617 | (11.152) | - | 9.465 | (11.152) | 11.152 | - | - |
| UBS AG | 2.146.973 | (92.890) | - | 2.054.083 | (92.890) | 92.890 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 15.413.999 | (1.367.921) | - | 14.046.078 | (1.367.921) | 1.367.921 | - | - |
| Insgesamt | 20.728.058 | (3.015.259) | (520.000) | 17.192.799 | (5.513.615) | 3.015.259 | - | (2.498.356) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Strategic Income (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten | |
|------------------------|--|--|---|--|
| | US\$ | | US\$ | |
| Devisenterminkontrakte | 29.520.687 | | (7.161.491) | |
| OTC-Kontrakt | - | | (3.863.949) | |
| Insgesamt | 29.520.687 | | (11.025.440) | |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Barclays Bank Plc | 19.490 | - | - | 19.490 | - | - | - | - |
| Citibank NA | 120.797 | (120.797) | - | - | (539.198) | 120.797 | - | (418.401) |
| Goldman Sachs International | 911.721 | (911.721) | - | - | (7.314.951) | 911.721 | 3.390.000 | (3.013.230) |
| JPMorgan Chase Bank | 306.288 | (50.895) | - | 255.393 | (50.895) | 50.895 | - | - |
| Morgan Stanley | 13.556 | - | - | 13.556 | - | - | - | - |
| Royal Bank of Canada | 550.752 | (550.752) | - | - | (1.936.869) | 550.752 | - | (1.386.117) |
| UBS AG | 986.309 | (624.056) | - | 362.253 | (624.056) | 624.056 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 26.611.774 | (559.471) | - | 26.052.303 | (559.471) | 559.471 | - | - |
| Insgesamt | 29.520.687 | (2.817.692) | - | 26.702.995 | (11.025.440) | 2.817.692 | 3.390.000 | (4.817.748) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Sustainable Asia High Yield

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 16.926 | (496) |
| Insgesamt | 16.926 | (496) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|--------------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Goldman Sachs International | 105 | (105) | - | - | (126) | 105 | - | (21) |
| Standard Chartered Bank | 15 | - | - | 15 | - | - | - | - |
| State Street Bank and Trust Co | 843 | - | - | 843 | - | - | - | - |
| UBS AG | 1.040 | - | - | 1.040 | - | - | - | - |
| Westpac Banking Corp | 14.923 | (370) | - | 14.553 | (370) | 370 | - | - |
| Insgesamt | 16.926 | (475) | - | 16.451 | (496) | 475 | - | (21) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Sustainable Asia High Yield (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 282.337 | (29.229) |
| Insgesamt | 282.337 | (29.229) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|--------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Goldman Sachs International | 4.110 | (4.110) | - | - | (11.267) | 4.110 | - | (7.157) |
| Standard Chartered Bank | 664 | (191) | - | 473 | (191) | 191 | - | - |
| State Street Bank and Trust Co | 7.594 | - | - | 7.594 | - | - | - | - |
| Westpac Banking Corp | 269.969 | (17.771) | - | 252.198 | (17.771) | 17.771 | - | - |
| Insgesamt | 282.337 | (22.072) | - | 260.265 | (29.229) | 22.072 | - | (7.157) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Corporate Debt

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten | |
|------------------------|--|-----------|---|-----------|
| | US\$ | | US\$ | |
| Devisenterminkontrakte | | 1.906.675 | | (235.957) |
| Insgesamt | | 1.906.675 | | (235.957) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| | | | | | | | | |
| Citibank NA | 1.408 | (1.408) | - | - | (2.055) | 1.408 | - | (647) |
| Goldman Sachs International | 16.405 | (16.405) | - | - | (203.177) | 16.405 | - | (186.772) |
| HSBC Bank Plc | - | - | - | - | (27.498) | - | - | (27.498) |
| UBS AG | 1.856.149 | (3.024) | - | 1.853.125 | (3.024) | 3.024 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 32.713 | (203) | - | 32.510 | (203) | 203 | - | - |
| Insgesamt | 1.906.675 | (21.040) | - | 1.885.635 | (235.957) | 21.040 | - | (214.917) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Corporate Debt (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten | |
|------------------------|--|--|---|--|
| | US\$ | | US\$ | |
| Devisenterminkontrakte | 853.222 | | (134.345) | |
| Insgesamt | 853.222 | | (134.345) | |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| | | | | | | | | |
| Goldman Sachs International | 8.040 | (1.385) | - | 6.655 | (1.385) | 1.385 | - | - |
| JPMorgan Chase Bank | - | - | - | - | (713) | - | - | (713) |
| UBS AG | - | - | - | - | (3.614) | - | - | (3.614) |
| Westpac Banking Corp | 845.182 | (128.633) | - | 716.549 | (128.633) | 128.633 | - | - |
| Insgesamt | 853.222 | (130.018) | - | 723.204 | (134.345) | 130.018 | - | (4.327) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency²

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 8.781.301 | (2.051.066) |
| Insgesamt | 8.781.301 | (2.051.066) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|--------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Citibank NA | 117.098 | (88.311) | - | 28.787 | (88.311) | 88.311 | - | - |
| Standard Chartered Bank | 8.367.376 | (1.499.461) | - | 6.867.915 | (1.499.461) | 1.499.461 | - | - |
| State Street Bank and Trust Co | 116.450 | (29.672) | - | 86.778 | (29.672) | 29.672 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 180.377 | (180.377) | - | - | (433.622) | 180.377 | - | (253.245) |
| Insgesamt | 8.781.301 | (1.797.821) | - | 6.983.480 | (2.051.066) | 1.797.821 | - | (253.245) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency² (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 1.237.337 | (862.058) |
| Insgesamt | 1.237.337 | (862.058) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|--------------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| JPMorgan Chase Bank | - | - | - | - | (18.613) | - | - | (18.613) |
| Standard Chartered Bank | - | - | - | - | (832.685) | - | - | (832.685) |
| State Street Bank and Trust Co | - | - | - | - | (3.534) | - | - | (3.534) |
| Westpac Banking Corp | 1.237.337 | (7.226) | - | 1.230.111 | (7.226) | 7.226 | - | - |
| Insgesamt | 1.237.337 | (7.226) | - | 1.230.111 | (862.058) | 7.226 | - | (854.832) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Tactical Macro¹

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 67.331 | (36.811) |
| OTC-Optionen | 81.790 | (81.790) |
| Insgesamt | 149.121 | (118.601) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Goldman Sachs International | 149.121 | (118.601) | - | 30.520 | (118.601) | 118.601 | - | - |
| Insgesamt | 149.121 | (118.601) | - | 30.520 | (118.601) | 118.601 | - | - |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Ultra Short Term Euro Bond

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | EUR | EUR |
| Devisenterminkontrakte | 235.719 | (2.512.078) |
| Insgesamt | 235.719 | (2.512.078) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|---|--|--|-----------------------------------|---|---|--|-----------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten EUR | Erhaltene Sicherheiten ^(a) EUR | Nettobetrag ^(b) EUR | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte EUR | Verpfändete Sicherheiten ^(a) EUR | Nettobetrag ^(b) EUR |
| Goldman Sachs International | 1.594 | (1.594) | - | - | (42.515) | 1.594 | - | (40.921) |
| Westpac Banking Corp | 234.125 | (234.125) | - | - | (2.469.563) | 234.125 | - | (2.235.438) |
| Insgesamt | 235.719 | (235.719) | - | - | (2.512.078) | 235.719 | - | (2.276.359) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Ultra Short Term Euro Bond (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | EUR | EUR |
| Devisenterminkontrakte | 232.108 | (6.570.781) |
| Insgesamt | 232.108 | (6.570.781) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|--|---|---|--------------------------------|--|--|---|--------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten EUR | Erhaltene Sicherheiten ^(a) EUR | Nettobetrag ^(b) EUR | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte EUR | Verpfändete Sicherheiten ^(a) EUR | Nettobetrag ^(b) EUR |
| Goldman Sachs International | 3.596 | (3.596) | - | - | (44.332) | 3.596 | - | (40.736) |
| Westpac Banking Corp | 228.512 | (228.512) | - | - | (6.526.449) | 228.512 | - | (6.297.937) |
| Insgesamt | 232.108 | (232.108) | - | - | (6.570.781) | 232.108 | - | (6.338.673) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 91.871.867 | (53.084.382) |
| OTC-Optionen | 207.424.442 | (356.216.715) |
| OTC-Kontrakt | 134.147.954 | (36.578.579) |
| OTC Swaptions | 40.202 | (29.043) |
| Insgesamt | 433.484.465 | (445.908.719) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

Vermögenswerte

Verbindlichkeiten

| Gegenpartei | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge | | Erhaltene Sicherheiten ^(a) | Nettobetrag ^(b) | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge | | Verpfändete Sicherheiten ^(a) | Nettobetrag ^(b) |
|--------------------------------|--|--|---------------------------------------|----------------------------|--|---|---|----------------------------|
| | US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | | | US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | | |
| Barclays Bank Plc | 268.757 | (60.423) | - | 208.334 | (60.423) | 60.423 | - | - |
| Bank of America Merrill Lynch | 4.895.611 | (4.895.611) | - | - | (5.073.462) | 4.895.611 | 177.851 | - |
| BNP Paribas | 13.781.080 | (3.460.943) | - | 10.320.137 | (3.460.943) | 3.460.943 | - | - |
| Citibank NA | 3.965.367 | (848.919) | - | 3.116.448 | (848.919) | 848.919 | - | - |
| Daiwa | 1.777.376 | - | - | 1.777.376 | - | - | - | - |
| Deutsche Bank AG | 57.980 | (57.980) | - | - | (68.611) | 57.980 | - | (10.631) |
| Goldman Sachs International | 165.131.686 | (165.131.686) | - | - | (188.950.111) | 165.131.686 | - | (23.818.425) |
| HSBC Bank Plc | 1.687.310 | (1.687.310) | - | - | (3.179.642) | 1.687.310 | - | (1.492.332) |
| JPMorgan Chase Bank | 67.750.448 | (67.750.448) | - | - | (204.346.512) | 67.750.448 | - | (136.596.064) |
| Morgan Stanley | 11.818.255 | (11.818.255) | - | - | (15.261.190) | 11.818.255 | 3.442.935 | - |
| Nomura | 38.780.664 | (2.711.483) | - | 36.069.181 | (2.711.483) | 2.711.483 | - | - |
| Royal Bank of Scotland | 29.607 | (13.466) | - | 16.141 | (13.466) | 13.466 | - | - |
| SMBC Nikko Capital Markets Ltd | 1.726.344 | - | - | 1.726.344 | - | - | - | - |
| Société Générale | 50.986.074 | (773.632) | - | 50.212.442 | (773.632) | 773.632 | - | - |
| State Street Bank and Trust Co | 1.726.917 | (1.469.262) | - | 257.655 | (1.469.262) | 1.469.262 | - | - |
| UBS AG | 65.878.290 | (2.623.895) | - | 63.254.395 | (2.623.895) | 2.623.895 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 3.222.699 | (3.222.699) | - | - | (17.067.168) | 3.222.699 | - | (13.844.469) |
| Insgesamt | 433.484.465 | (266.526.012) | - | 166.958.453 | (445.908.719) | 266.526.012 | 3.620.786 | (175.761.921) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US\$ | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US\$ |
|------------------------|--|---|
| Devisenterminkontrakte | 212.294.005 | (37.812.332) |
| OTC-Kontrakt | 135.115.207 | (73.650.446) |
| OTC-Optionen | 131.345.140 | (284.967.910) |
| OTC Swaptions | 1.388.392 | (708.024) |
| Insgesamt | 480.142.744 | (397.138.712) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|--------------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Barclays Bank Plc | 131 | - | - | 131 | - | - | - | - |
| Bank of America Merrill Lynch | 25.332.023 | (12.164.030) | - | 13.167.993 | (12.164.030) | 12.164.030 | - | - |
| BNP Paribas | 25.173.420 | (770.244) | (5.000) | 24.398.176 | (770.244) | 770.244 | - | - |
| Citibank NA | 969.403 | (127.806) | (110.000) | 731.597 | (127.806) | 127.806 | - | - |
| Daiwa | 21.787 | - | - | 21.787 | - | - | - | - |
| Deutsche Bank AG | 263.885 | (263.885) | - | - | (274.819) | 263.885 | - | (10.934) |
| Goldman Sachs International | 65.259.726 | (48.888.862) | - | 16.370.864 | (48.888.862) | 48.888.862 | - | - |
| JPMorgan Chase Bank | 131.590.229 | (131.590.229) | - | - | (294.012.216) | 131.590.229 | 162.421.987 | - |
| Morgan Stanley | 24.129.157 | (24.129.157) | - | - | (27.235.440) | 24.129.157 | 3.106.283 | - |
| Nomura International | 7.243.522 | (130.072) | - | 7.113.450 | (130.072) | 130.072 | - | - |
| Royal Bank of Canada | 65.198 | (3.929) | - | 61.269 | (3.929) | 3.929 | - | - |
| Royal Bank of Scotland | 385.989 | (103.346) | - | 282.643 | (103.346) | 103.346 | - | - |
| SMBC Nikko Capital Markets Ltd | 1.202.717 | - | - | 1.202.717 | - | - | - | - |
| Société Générale | 10.320.647 | (2.854.549) | - | 7.466.098 | (2.854.549) | 2.854.549 | - | - |
| State Street Bank and Trust Co | 140.078.733 | (2.627.400) | - | 137.451.333 | (2.627.400) | 2.627.400 | - | - |
| UBS AG | 23.625.469 | (2.801.808) | - | 20.823.661 | (2.801.808) | 2.801.808 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 24.480.708 | (5.144.191) | - | 19.336.517 | (5.144.191) | 5.144.191 | - | - |
| Insgesamt | 480.142.744 | (231.599.508) | (115.000) | 248.428.236 | (397.138.712) | 231.599.508 | 165.528.270 | (10.934) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Trading^{2*}

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten | |
|------------------------|--|--|---|--|
| | US\$ | | US\$ | |
| Devisenterminkontrakte | 54.485.356 | | (6.317.151) | |
| OTC-Kontrakt | 17.299.613 | | (5.597.643) | |
| OTC-Optionen | 20.845.166 | | (36.846.895) | |
| OTC Swaptions | 68.848 | | (20.738) | |
| Insgesamt | 92.698.983 | | (48.782.427) | |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|--------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| | | | | | | | | |
| Bank of America Merrill Lynch | 6.835.857 | (6.835.857) | - | - | (7.154.155) | 6.835.857 | 318.298 | - |
| BNP Paribas | 710.195 | (477.433) | - | 232.762 | (477.433) | 477.433 | - | - |
| Daiwa | 334.964 | - | - | 334.964 | - | - | - | - |
| Goldman Sachs International | 3.131.104 | (3.131.104) | - | - | (4.054.674) | 3.131.104 | - | (923.570) |
| JPMorgan Chase Bank | 14.193.789 | (14.193.789) | - | - | (34.580.892) | 14.193.789 | 20.387.103 | - |
| Morgan Stanley | 222.140 | (222.140) | - | - | (227.302) | 222.140 | - | (5.162) |
| Nomura International | 2.318.816 | (42.011) | - | 2.276.805 | (42.011) | 42.011 | - | - |
| SMBC Nikko Capital Markets Ltd | 1.907.956 | - | - | 1.907.956 | - | - | - | - |
| Société Générale | 8.370.879 | (1.230.904) | - | 7.139.975 | (1.230.904) | 1.230.904 | - | - |
| State Street Bank and Trust Co | 49.433.338 | - | - | 49.433.338 | - | - | - | - |
| UBS AG | 4.886.978 | (509.845) | - | 4.377.133 | (509.845) | 509.845 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 352.967 | (352.967) | - | - | (505.211) | 352.967 | - | (152.244) |
| Insgesamt | 92.698.983 | (26.996.050) | - | 65.702.933 | (48.782.427) | 26.996.050 | 20.705.401 | (1.080.976) |

* Das Portfolio wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Equity

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 1.253.492 | (118.963) |
| Insgesamt | 1.253.492 | (118.963) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|----------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Royal Bank of Canada | 103.962 | (35.323) | - | 68.639 | (35.323) | 35.323 | - | - |
| UBS AG | 1.114.639 | (46.969) | - | 1.067.670 | (46.969) | 46.969 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 34.891 | (34.891) | - | - | (36.671) | 34.891 | - | (1.780) |
| Insgesamt | 1.253.492 | (117.183) | - | 1.136.309 | (118.963) | 117.183 | - | (1.780) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Equity (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 2.158.080 | (546.931) |
| Insgesamt | 2.158.080 | (546.931) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|----------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Royal Bank of Canada | 70.555 | (70.555) | - | - | (140.295) | 70.555 | - | (69.740) |
| UBS AG | 98.971 | (35.034) | - | 63.937 | (35.034) | 35.034 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 1.988.554 | (371.602) | - | 1.616.952 | (371.602) | 371.602 | - | - |
| Insgesamt | 2.158.080 | (477.191) | - | 1.680.889 | (546.931) | 477.191 | - | (69.740) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Equity Index PutWrite

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 12.128.805 | (538.104) |
| Insgesamt | 12.128.805 | (538.104) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Goldman Sachs International | 92.390 | (92.390) | - | - | (278.135) | 92.390 | - | (185.745) |
| Westpac Banking Corp | 12.036.415 | (259.969) | - | 11.776.446 | (259.969) | 259.969 | - | - |
| Insgesamt | 12.128.805 | (352.359) | - | 11.776.446 | (538.104) | 352.359 | - | (185.745) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Equity Index PutWrite (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten | |
|------------------------|--|--|---|--|
| | US\$ | | US\$ | |
| Devisenterminkontrakte | 16.592.327 | | (1.350.871) | |
| Insgesamt | 16.592.327 | | (1.350.871) | |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Goldman Sachs International | 177.418 | (177.418) | - | - | (408.941) | 177.418 | - | (231.523) |
| Westpac Banking Corp | 16.414.909 | (941.930) | - | 15.472.979 | (941.930) | 941.930 | - | - |
| Insgesamt | 16.592.327 | (1.119.348) | - | 15.472.979 | (1.350.871) | 1.119.348 | - | (231.523) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Large Cap Value

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 1.119.012 | (115.827) |
| Insgesamt | 1.119.012 | (115.827) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-------------------------|--|---|---------------------------------------|----------------------------|--|--|---|----------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten | Erhaltene Sicherheiten ^(a) | Nettobetrag ^(b) | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte | Verpfändete Sicherheiten ^(a) | Nettobetrag ^(b) |
| | | | | | | | | |
| Standard Chartered Bank | 1.032.749 | (35.893) | - | 996.856 | (35.893) | 35.893 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 86.263 | (79.934) | - | 6.329 | (79.934) | 79.934 | - | - |
| Insgesamt | 1.119.012 | (115.827) | - | 1.003.185 | (115.827) | 115.827 | - | - |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Large Cap Value (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 973.737 | (102.612) |
| Insgesamt | 973.737 | (102.612) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| JPMorgan Chase Bank | 276.563 | (8.511) | - | 268.052 | (8.511) | 8.511 | - | - |
| Standard Chartered Bank | 253.879 | (10.265) | - | 243.614 | (10.265) | 10.265 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 443.295 | (83.836) | - | 359.459 | (83.836) | 83.836 | - | - |
| Insgesamt | 973.737 | (102.612) | - | 871.125 | (102.612) | 102.612 | - | - |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Long Short Equity

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 3.283.704 | (342.870) |
| OTC-Kontrakt | 624.429 | (7.376.089) |
| Insgesamt | 3.908.133 | (7.718.959) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Citibank NA | 59.547 | (41.584) | - | 17.963 | (41.584) | 41.584 | - | - |
| Goldman Sachs International | 544.502 | (544.502) | - | - | (4.944.489) | 544.502 | 4.399.987 | - |
| JPMorgan Chase Bank | 60.931 | (60.931) | - | - | (2.392.877) | 60.931 | 2.331.946 | - |
| UBS AG | 1.621.720 | (80.607) | - | 1.541.113 | (80.607) | 80.607 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 1.621.433 | (259.402) | - | 1.362.031 | (259.402) | 259.402 | - | - |
| Insgesamt | 3.908.133 | (987.026) | - | 2.921.107 | (7.718.959) | 987.026 | 6.731.933 | - |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Long Short Equity (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 6.686.844 | (822.791) |
| OTC-Kontrakt | 3.827.134 | (1.992.712) |
| Insgesamt | 10.513.978 | (2.815.503) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Goldman Sachs International | 3.014.864 | (1.622.276) | - | 1.392.588 | (1.622.276) | 1.622.276 | - | - |
| JPMorgan Chase Bank | 871.513 | (372.750) | - | 498.763 | (372.750) | 372.750 | - | - |
| UBS AG | 35.400 | (35.400) | - | - | (76.976) | 35.400 | - | (41.576) |
| Westpac Banking Corp | 6.592.201 | (743.501) | - | 5.848.700 | (743.501) | 743.501 | - | - |
| Insgesamt | 10.513.978 | (2.773.927) | - | 7.740.051 | (2.815.503) | 2.773.927 | - | (41.576) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten | |
|------------------------|--|-----------|---|-----------|
| | US\$ | | US\$ | |
| Devisenterminkontrakte | | 1.843.892 | | (325.170) |
| Insgesamt | | 1.843.892 | | (325.170) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Goldman Sachs International | 1.114.025 | (44.932) | - | 1.069.093 | (44.932) | 44.932 | - | - |
| UBS AG | 178.194 | (24.196) | - | 153.998 | (24.196) | 24.196 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 551.673 | (256.042) | - | 295.631 | (256.042) | 256.042 | - | - |
| Insgesamt | 1.843.892 | (325.170) | - | 1.518.722 | (325.170) | 325.170 | - | - |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 2.736.142 | (587.402) |
| Insgesamt | 2.736.142 | (587.402) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Goldman Sachs International | 678.594 | (86.777) | - | 591.817 | (86.777) | 86.777 | - | - |
| UBS AG | 103.906 | (68.135) | - | 35.771 | (68.135) | 68.135 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 1.953.642 | (432.490) | - | 1.521.152 | (432.490) | 432.490 | - | - |
| Insgesamt | 2.736.142 | (587.402) | - | 2.148.740 | (587.402) | 587.402 | - | - |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 2.358.847 | (441.683) |
| Insgesamt | 2.358.847 | (441.683) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| | | | | | | | | |
| Goldman Sachs International | 935.666 | (123.497) | - | 812.169 | (123.497) | 123.497 | - | - |
| UBS AG | 321.901 | (132.714) | - | 189.187 | (132.714) | 132.714 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 1.101.280 | (185.472) | - | 915.808 | (185.472) | 185.472 | - | - |
| Insgesamt | 2.358.847 | (441.683) | - | 1.917.164 | (441.683) | 441.683 | - | - |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 4.089.640 | (1.230.032) |
| Insgesamt | 4.089.640 | (1.230.032) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | | |
|-----------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|--|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | |
| | | | | | | | | | |
| Goldman Sachs International | 1.575.053 | (296.037) | - | 1.279.016 | (296.037) | 296.037 | - | - | |
| UBS AG | 112.854 | (41.658) | - | 71.196 | (41.658) | 41.658 | - | - | |
| Westpac Banking Corp | 2.401.733 | (892.337) | - | 1.509.396 | (892.337) | 892.337 | - | - | |
| Insgesamt | 4.089.640 | (1.230.032) | - | 2.859.608 | (1.230.032) | 1.230.032 | - | - | |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Small Cap

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 747.370 | (137.144) |
| Insgesamt | 747.370 | (137.144) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Goldman Sachs International | 110.085 | (31.210) | - | 78.875 | (31.210) | 31.210 | - | - |
| UBS AG | 209.485 | (22.829) | - | 186.656 | (22.829) | 22.829 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 427.800 | (83.105) | - | 344.695 | (83.105) | 83.105 | - | - |
| Insgesamt | 747.370 | (137.144) | - | 610.226 | (137.144) | 137.144 | - | - |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Small Cap (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
| | US\$ | US\$ |
| Devisenterminkontrakte | 949.457 | (236.699) |
| Insgesamt | 949.457 | (236.699) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | |
|-----------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten ^(a) US\$ | Nettobetrag ^(b) US\$ |
| Goldman Sachs International | 186.760 | (54.952) | - | 131.808 | (54.952) | 54.952 | - | - |
| UBS AG | 17.959 | (7.319) | - | 10.640 | (7.319) | 7.319 | - | - |
| Westpac Banking Corp | 744.738 | (174.428) | - | 570.310 | (174.428) | 174.428 | - | - |
| Insgesamt | 949.457 | (236.699) | - | 712.758 | (236.699) | 236.699 | - | - |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Small Cap Intrinsic Value

31. Dezember 2023

| Beschreibung | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten | |
|------------------------|--|--|---|-------|
| | US\$ | | US\$ | |
| Devisenterminkontrakte | - | | | (398) |
| Insgesamt | - | | | (398) |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei | Vermögenswerte | | | | Verbindlichkeiten | | | | | |
|-------------------------|--|------|---|------|--|------|--|------|---|----------------------------|
| | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge | | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten | | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge | | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte | | Verpfändete Sicherheiten ^(a) | Nettobetrag ^(b) |
| | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | US\$ | | |
| Brown Brothers Harriman | - | - | - | - | (398) | - | - | - | (398) | |
| Insgesamt | - | - | - | - | (398) | - | - | - | (398) | |

31. Dezember 2022

Keine zur Saldierung verfügbaren Vermögenswerte und Verbindlichkeiten aus OTC-Derivaten und Wertpapierleihgeschäften.

(a) Die erhaltenen (oder verpfändeten) Sicherheiten sind auf einen Betrag begrenzt, der 100 % des Nettobetrags der Vermögenswerte (oder Verbindlichkeiten) in den oben dargestellten Tabellen für die jeweilige Gegenpartei nicht überschreiten darf.

(b) Ein Nettobetrag größer als null entspricht den Beträgen, die bei einem Ausfall einer Gegenpartei zum 31. Dezember 2023 einem Verlust unterliegen. Ein Nettobetrag kleiner als null entspricht für jede Gegenpartei unterbesicherte Beträge zum 31. Dezember 2023.

¹ Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

² Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR**27. GESCHLOSSENE FONDS**

Neben den in diesem Bericht aufgeführten Fonds gibt es eine Reihe geschlossener Teilfonds, deren Zulassung noch nicht zurückgenommen wurde.

Eine vollständige Liste dieser Fonds ist nachstehend angegeben. Am Ende des Geschäftsjahres zum 31. Dezember 2023 hielt einer dieser Teilfonds, der Lehman Brothers Commodity Plus Fund, einen Betrag in Höhe von 1,93 Mio. US\$ (31. Dezember 2022: 1,84 Mio. US\$) auf einem Konto bei der Verwahrstelle in Zusammenhang mit einem noch nicht beigelegten Rechtsstreit hinsichtlich einer Derivate-Transaktion.

- Lehman Brothers Global Value Fund
- Lehman Brothers USA Value Fund
- Lehman Brothers European Value Fund
- Lehman Brothers Global Bond Fund
- Lehman Brothers Commodity Plus Fund
- Lehman Brothers Alpha Select 2 Fund
- Lehman Brothers Alpha Select 4 Fund

Anhang I

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT)

Für das zum 31. Dezember 2023 endende Geschäftsjahr basieren die Gesamtkostenquoten („TERs“) auf die den angegebenen Daten vorangegangenen zwölf Monate.

31. Dezember 2023

5G Connectivity

| Anteilklasse | Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht) |
|---|---|--|
| Thesaurierende Klasse AUD A | 1,82 % | 1,82 % |
| Thesaurierende Klasse AUD I2 | 0,81 % | 0,81 % |
| Thesaurierende Klasse CHF A | 1,83 % | 1,83 % |
| Thesaurierende Klasse CHF I | 0,98 % | 0,98 % |
| Thesaurierende Klasse CHF I2 | 0,82 % | 0,82 % |
| Thesaurierende Klasse CNY A | 1,82 % | 1,82 % |
| Thesaurierende Klasse CNY I2 | 0,81 % | 0,81 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 1,82 % | 1,82 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) | 1,82 % | 1,82 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 0,97 % | 0,97 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | 0,97 % | 0,97 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 0,81 % | 0,81 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 0,55 % | 0,55 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | 2,62 % | 2,62 % |
| Thesaurierende Klasse GBP A | 1,82 % | 1,82 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | 0,96 % | 0,96 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I2 | 0,81 % | 0,81 % |
| Thesaurierende Klasse HKD A | 1,82 % | 1,82 % |
| Thesaurierende Klasse HKD I2 | 0,81 % | 0,81 % |
| Thesaurierende Klasse SGD A | 1,82 % | 1,82 % |
| Thesaurierende Klasse SGD I2 | 0,81 % | 0,81 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,82 % | 1,82 % |
| Thesaurierende Klasse USD E | 2,92 % | 2,92 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,97 % | 0,97 % |
| Ausschüttende Klasse USD I | 0,97 % | 0,97 % |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 0,79 % | 0,79 % |
| Thesaurierende Klasse USD I3 | 0,71 % | 0,71 % |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 0,54 % | 0,54 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 2,62 % | 2,62 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,12 % | 0,12 % |

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

5G Connectivity (Fortsetzung)

| Anteilklasse | Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht) |
|-----------------------------|---|--|
| Thesaurierende Klasse ZAR A | 1,81 % | 1,81 % |
| Thesaurierende Klasse ZAR E | 2,93 % | 2,93 % |

China A-Share Equity

| | | |
|---|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse CNY I | 7,60 % | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) | 7,59 % | 1,20 % |
| Ausschüttende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) | 7,60 % | 1,20 % |

China Bond

| | | |
|--|--------|--------|
| Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) | 1,65 % | 1,50 % |
| Ausschüttende Klasse CNY I | 1,01 % | 0,85 % |
| Thesaurierende Klasse CNY Z | 0,36 % | 0,20 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I2 | 0,88 % | 0,72 % |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) (nicht währungsgesichert) | 1,65 % | 1,50 % |
| Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) | 1,00 % | 0,85 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,36 % | 0,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z (nicht währungsgesichert) | 0,36 % | 0,20 % |

China Equity

| | | |
|------------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse CHF I | 1,27 % | 1,27 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 2,02 % | 2,02 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 1,27 % | 1,27 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Z | 0,16 % | 0,16 % |
| Ausschüttende Klasse GBP A | 2,01 % | 2,01 % |
| Thesaurierende Klasse SGD A | 2,02 % | 2,02 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 2,02 % | 2,02 % |
| Ausschüttende Klasse USD A | 2,02 % | 2,02 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 1,27 % | 1,27 % |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 1,06 % | 1,06 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 3,01 % | 3,01 % |
| Thesaurierende Klasse USD U | 1,62 % | 1,62 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,17 % | 0,17 % |

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

Climate Innovation¹

| Anteilklasse | Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht) |
|------------------------------|---|--|
| Thesaurierende Klasse USD A | 6,45 % | 1,90 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 5,59 % | 1,05 % |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 5,16 % | 0,63 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 4,76 % | 0,20 % |

CLO Income

| | | |
|-----------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR A | 1,66 % | 1,66 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 0,93 % | 0,93 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I2 | 0,76 % | 0,76 % |
| Thesaurierende Klasse GBP Z | 0,17 % | 0,17 % |
| Thesaurierende Klasse SEK I | 0,92 % | 0,92 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,67 % | 1,67 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,94 % | 0,94 % |
| Ausschüttende Klasse USD I | 0,96 % | 0,96 % |
| Ausschüttende Klasse USD I2 | 0,77 % | 0,77 % |
| Ausschüttende Klasse USD I5 | 0,54 % | 0,54 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,17 % | 0,17 % |

Commodities²

| | | |
|---|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | 0,92 % | 0,85 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 | 0,56 % | 0,53 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,62 % | 1,60 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,88 % | 0,85 % |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 0,55 % | 0,53 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 2,23 % | 2,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,23 % | 0,20 % |

Corporate Hybrid Bond

| | | |
|--|--------|--------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | 1,28 % | 1,28 % |
| Thesaurierende Klasse CHF P | 0,64 % | 0,64 % |
| Ausschüttende Klasse CHF P | 0,65 % | 0,65 % |

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

| Anteilklasse | Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht) |
|--|---|--|
| Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) | 1,28 % | 1,28 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 1,28 % | 1,28 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 0,68 % | 0,68 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I | 0,68 % | 0,68 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 0,56 % | 0,56 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I2 | 0,56 % | 0,56 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I3 | 0,50 % | 0,50 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 0,38 % | 0,38 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 1,88 % | 1,88 % |
| Ausschüttende Klasse EUR M | 1,88 % | 1,88 % |
| Thesaurierende Klasse EUR P | 0,65 % | 0,65 % |
| Ausschüttende Klasse EUR P | 0,65 % | 0,65 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I | 0,68 % | 0,68 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I2 | 0,56 % | 0,56 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I2 | 0,55 % | 0,55 % |
| Thesaurierende Klasse GBP P | 0,65 % | 0,65 % |
| Ausschüttende Klasse GBP P | 0,65 % | 0,65 % |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 1,28 % | 1,28 % |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,28 % | 1,28 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,28 % | 1,28 % |
| Ausschüttende Klasse USD A | 1,27 % | 1,27 % |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 2,28 % | 2,28 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,68 % | 0,68 % |
| Ausschüttende Klasse USD I | 0,68 % | 0,68 % |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 0,56 % | 0,56 % |
| Ausschüttende Klasse USD I2 | 0,56 % | 0,56 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 1,88 % | 1,88 % |
| Ausschüttende Klasse USD M | 1,88 % | 1,88 % |
| Thesaurierende Klasse USD P | 0,65 % | 0,65 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,08 % | 0,08 % |

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

Developed Market FMP – 2027¹

| Anteilklasse | Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht) |
|-----------------------------|---|--|
| Thesaurierende Klasse EUR A | 0,79 % | 0,79 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I | 0,40 % | 0,40 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 0,78 % | 0,78 % |
| Ausschüttende Klasse USD A | 0,79 % | 0,79 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,44 % | 0,44 % |
| Ausschüttende Klasse USD I | 0,41 % | 0,41 % |
| Thesaurierende Klasse USD X | 0,52 % | 0,52 % |
| Ausschüttende Klasse USD X | 0,58 % | 0,55 % |

Emerging Market Debt - Hard Currency

| | | |
|--|--------|--------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | 1,49 % | 1,49 % |
| Ausschüttende Klasse AUD I | 0,79 % | 0,79 % |
| Thesaurierende Klasse CAD I3 (nicht währungsgesichert) | 0,58 % | 0,58 % |
| Thesaurierende Klasse CHF I2 | 0,65 % | 0,65 % |
| Thesaurierende Klasse CHF P | 0,76 % | 0,76 % |
| Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) | 1,49 % | 1,49 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 1,49 % | 1,49 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 0,79 % | 0,79 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | 0,79 % | 0,79 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I | 0,79 % | 0,79 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 0,65 % | 0,65 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I2 | 0,65 % | 0,65 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I3 | 0,58 % | 0,58 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I4 | 0,51 % | 0,51 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) | 0,44 % | 0,44 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 2,29 % | 2,29 % |
| Ausschüttende Klasse EUR M | 2,29 % | 2,29 % |
| Thesaurierende Klasse EUR P | 0,76 % | 0,76 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Z | 0,09 % | 0,09 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I | 0,79 % | 0,79 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I | 0,79 % | 0,79 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I2 | 0,65 % | 0,65 % |

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

| Anteilklasse | Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht) |
|--|---|--|
| Ausschüttende Klasse GBP I2 | 0,65 % | 0,65 % |
| Thesaurierende Klasse GBP P | 0,76 % | 0,76 % |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) | 1,49 % | 1,49 % |
| Thesaurierende Klasse JPY I | 0,79 % | 0,79 % |
| Thesaurierende Klasse SEK A | 1,49 % | 1,49 % |
| Thesaurierende Klasse SEK I2 | 0,65 % | 0,65 % |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 1,49 % | 1,49 % |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,49 % | 1,49 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,49 % | 1,49 % |
| Ausschüttende Klasse USD A | 1,49 % | 1,49 % |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 2,49 % | 2,49 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,79 % | 0,79 % |
| Ausschüttende Klasse USD I | 0,79 % | 0,79 % |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 0,66 % | 0,66 % |
| Ausschüttende Klasse USD I2 | 0,66 % | 0,66 % |
| Ausschüttende Klasse USD I3 | 0,58 % | 0,58 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 2,29 % | 2,29 % |
| Ausschüttende Klasse USD M | 2,29 % | 2,29 % |
| Thesaurierende Klasse USD P | 0,76 % | 0,76 % |
| Thesaurierende Klasse USD X | 0,51 % | 0,51 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,09 % | 0,09 % |

Emerging Market Debt - Local Currency

| | | |
|--|--------|--------|
| Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) | 2,98 % | 2,98 % |
| Thesaurierende Klasse AUD B | 2,98 % | 2,98 % |
| Thesaurierende Klasse AUD C2 | 2,90 % | 2,90 % |
| Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) | 2,98 % | 2,98 % |
| Thesaurierende Klasse AUD E | 2,98 % | 2,98 % |
| Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) | 1,98 % | 1,98 % |
| Thesaurierende Klasse AUD T | 1,98 % | 1,98 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 1,67 % | 1,67 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 0,93 % | 0,93 % |

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

| Anteilklasse | Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht) |
|--|---|--|
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | 0,93 % | 0,93 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert) | 0,78 % | 0,78 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) | 0,63 % | 0,63 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Y (nicht währungsgesichert) | 0,54 % | 0,54 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I | 0,94 % | 0,94 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) | 0,63 % | 0,63 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) | 0,63 % | 0,63 % |
| Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert) | 0,54 % | 0,54 % |
| Thesaurierende Klasse SEK A | 1,68 % | 1,68 % |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 1,68 % | 1,68 % |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,68 % | 1,68 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,68 % | 1,68 % |
| Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) | 2,98 % | 2,98 % |
| Thesaurierende Klasse USD B | 2,97 % | 2,97 % |
| Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich) | 2,98 % | 2,98 % |
| Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) | 2,98 % | 2,98 % |
| Thesaurierende Klasse USD E | 2,98 % | 2,98 % |
| Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) | 0,93 % | 0,93 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,93 % | 0,93 % |
| Ausschüttende Klasse USD I | 0,93 % | 0,93 % |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 0,78 % | 0,78 % |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 0,54 % | 0,54 % |
| Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) | 1,98 % | 1,98 % |
| Thesaurierende Klasse USD T | 1,98 % | 1,98 % |
| Thesaurierende Klasse USD X | 0,55 % | 0,48 % |
| Thesaurierende Klasse USD Y | 0,54 % | 0,54 % |
| Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich) | 2,98 % | 2,98 % |
| Thesaurierende Klasse ZAR B | 2,98 % | 2,98 % |
| Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich) | 2,97 % | 2,97 % |
| Thesaurierende Klasse ZAR C2 | 2,95 % | 2,95 % |
| Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) | 2,98 % | 2,98 % |
| Thesaurierende Klasse ZAR E | 2,97 % | 2,97 % |

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

| Anteilklasse | Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht) |
|--|---|--|
| Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) | 1,98 % | 1,98 % |
| Thesaurierende Klasse ZAR T | 1,98 % | 1,98 % |
| Emerging Market Debt Blend | | |
| Ausschüttende Klasse AUD I3 | 0,69 % | 0,69 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 1,60 % | 1,60 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 0,90 % | 0,90 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I | 0,90 % | 0,90 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 0,76 % | 0,76 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I2 | 0,76 % | 0,76 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I3 | 0,69 % | 0,69 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) | 0,62 % | 0,62 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 0,55 % | 0,55 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 2,40 % | 2,40 % |
| Ausschüttende Klasse EUR M | 2,41 % | 2,40 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Z | 0,20 % | 0,20 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I | 0,90 % | 0,90 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | 0,84 % | 0,84 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I | 0,90 % | 0,90 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | 0,90 % | 0,90 % |
| Thesaurierende Klasse GBP P | 0,87 % | 0,87 % |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | 0,87 % | 0,87 % |
| Thesaurierende Klasse GBP Z | 0,20 % | 0,20 % |
| Thesaurierende Klasse NOK U | 1,25 % | 1,25 % |
| Thesaurierende Klasse SEK A | 1,60 % | 1,60 % |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 1,60 % | 1,60 % |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,60 % | 1,60 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,60 % | 1,60 % |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 2,60 % | 2,60 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,90 % | 0,90 % |
| Ausschüttende Klasse USD I | 0,90 % | 0,90 % |
| Ausschüttende Klasse USD I2 | 0,76 % | 0,76 % |

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

| Anteilklasse | Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht) |
|------------------------------|---|--|
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 0,56 % | 0,55 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 2,40 % | 2,40 % |
| Ausschüttende Klasse USD M | 2,40 % | 2,40 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,20 % | 0,20 % |

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

| | | |
|------------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse AUD I2 | 0,93 % | 0,68 % |
| Thesaurierende Klasse NOK I | 1,03 % | 0,80 % |
| Thesaurierende Klasse NOK I3 | 0,97 % | 0,62 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 1,05 % | 0,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 0,93 % | 0,68 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,45 % | 0,20 % |

Emerging Markets Equity

| | | |
|--|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse AUD B | 3,50 % | 3,30 % |
| Thesaurierende Klasse AUD C2 | 3,50 % | 3,30 % |
| Thesaurierende Klasse AUD E | 3,49 % | 3,30 % |
| Thesaurierende Klasse AUD T | 2,51 % | 2,30 % |
| Ausschüttende Klasse CAD I (nicht währungsgesichert) | 1,51 % | 1,30 % |
| Ausschüttende Klasse CAD I2 | 1,31 % | 1,10 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 1,49 % | 1,30 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 3,51 % | 3,30 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Z | 0,51 % | 0,30 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I | 1,51 % | 1,30 % |
| Thesaurierende Klasse GBP Z | 0,51 % | 0,30 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 2,51 % | 2,30 % |
| Thesaurierende Klasse USD B | 3,50 % | 3,30 % |
| Thesaurierende Klasse USD C2 | 3,43 % | 3,30 % |
| Thesaurierende Klasse USD E | 3,50 % | 3,30 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 1,48 % | 1,30 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 3,50 % | 3,30 % |
| Thesaurierende Klasse USD T | 2,48 % | 2,30 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,51 % | 0,30 % |

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

| Anteilklasse | Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht) |
|------------------------------|---|--|
| Thesaurierende Klasse ZAR B | 3,51 % | 3,30 % |
| Thesaurierende Klasse ZAR C2 | 3,38 % | 3,30 % |
| Thesaurierende Klasse ZAR E | 3,51 % | 3,30 % |
| Thesaurierende Klasse ZAR T | 2,51 % | 2,30 % |

Euro Bond

| | | |
|-----------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR I | 1,83 % | 0,55 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I | 1,71 % | 0,55 % |

Euro Bond Absolute Return

| | | |
|------------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR I | 0,85 % | 0,65 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I | 0,87 % | 0,65 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 0,60 % | 0,43 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,40 % | 0,20 % |

European High Yield Bond

| | | |
|--|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse CHF I | 0,85 % | 0,80 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 0,83 % | 0,80 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 0,67 % | 0,67 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 0,47 % | 0,47 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 2,10 % | 2,00 % |
| Thesaurierende Klasse EUR X | 0,46 % | 0,40 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Y | 0,31 % | 0,30 % |
| Ausschüttende Klasse EUR Y | 0,32 % | 0,30 % |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,51 % | 1,40 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,91 % | 0,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD X | 0,54 % | 0,40 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,33 % | 0,20 % |

European Sustainable Equity

| | | |
|-----------------------------|--------|--------|
| Ausschüttende Klasse EUR A | 1,63 % | 1,63 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 0,74 % | 0,74 % |

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

European Sustainable Equity (Fortsetzung)

| Anteilklasse | Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht) |
|---|---|--|
| Ausschüttende Klasse EUR I | 0,71 % | 0,71 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I3 | 0,55 % | 0,55 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 0,44 % | 0,44 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 2,44 % | 2,44 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Z | 0,14 % | 0,14 % |
| Thesaurierende Klasse USD A (nicht währungsgesichert) | 1,62 % | 1,62 % |
| Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) | 0,71 % | 0,71 % |
| Thesaurierende Klasse USD M (nicht währungsgesichert) | 2,42 % | 2,42 % |

Event Driven²

| | | |
|------------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR I | 1,27 % | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 | 0,80 % | 0,70 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I5 | 0,79 % | 0,70 % |
| Thesaurierende Klasse GBP P | 1,24 % | 1,15 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 1,34 % | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 0,79 % | 0,70 % |

Global Bond

| | | |
|---|--------|--------|
| Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) | 1,01 % | 0,95 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I Benchmark Währungsgesicherte Klasse | 0,62 % | 0,40 % |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 1,68 % | 1,60 % |
| Thesaurierende Klasse USD I Benchmark Währungsgesicherte Klasse | 0,43 % | 0,35 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,52 % | 0,40 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 1,10 % | 1,00 % |
| Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) | 1,03 % | 0,95 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,28 % | 0,20 % |
| Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) | 1,01 % | 0,95 % |

Global Diversified Income FMP – 2024

| | | |
|-----------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR A | 0,90 % | 0,90 % |
| Ausschüttende Klasse EUR A | 0,90 % | 0,90 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I | 0,50 % | 0,50 % |

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

Global Diversified Income FMP – 2024 (Fortsetzung)

| Anteilklasse | Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht) |
|-----------------------------|---|--|
| Ausschüttende Klasse GBP I | 0,50 % | 0,50 % |
| Ausschüttende Klasse HKD A | 0,90 % | 0,90 % |
| Ausschüttende Klasse SGD A | 0,90 % | 0,90 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 0,90 % | 0,90 % |
| Ausschüttende Klasse USD A | 0,90 % | 0,90 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,50 % | 0,50 % |
| Ausschüttende Klasse USD I | 0,50 % | 0,50 % |
| Thesaurierende Klasse USD X | 0,55 % | 0,55 % |
| Ausschüttende Klasse USD X | 0,55 % | 0,55 % |

Global Equity Megatrends

| | | |
|---|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR I | 1,02 % | 1,02 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | 2,73 % | 2,73 % |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | 1,04 % | 1,04 % |
| Thesaurierende Klasse SGD A | 2,10 % | 2,00 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,93 % | 1,93 % |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 2,93 % | 2,93 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 1,08 % | 1,08 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 2,73 % | 2,73 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,23 % | 0,23 % |

Global Flexible Credit Income

| | | |
|------------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse CAD I5 | 0,41 % | 0,41 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 0,71 % | 0,71 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 2,11 % | 2,11 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 | 0,41 % | 0,41 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,31 % | 1,31 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,71 % | 0,71 % |
| Ausschüttende Klasse USD I | 0,71 % | 0,71 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 2,11 % | 2,11 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,11 % | 0,11 % |

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

Global High Yield SDG Engagement

| Anteilklasse | Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht) |
|----------------------------------|---|--|
| Ausschüttende Klasse AUD I | 0,73 % | 0,70 % |
| Thesaurierende Klasse CHF I4 | 0,50 % | 0,47 % |
| Ausschüttende Klasse CHF I4 | 0,50 % | 0,47 % |
| Thesaurierende Klasse CHF X | 1,22 % | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I4 | 0,50 % | 0,47 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I4 | 0,50 % | 0,47 % |
| Thesaurierende Klasse EUR X | 1,22 % | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Z (PF) | 0,23 % | 0,20 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I4 | 0,50 % | 0,47 % |
| Thesaurierende Klasse GBP X | 1,22 % | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,33 % | 1,30 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,74 % | 0,70 % |
| Thesaurierende Klasse USD I4 | 0,50 % | 0,47 % |
| Ausschüttende Klasse USD M | 1,93 % | 1,90 % |
| Thesaurierende Klasse USD X | 1,20 % | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,13 % | 0,10 % |

Global Investment Grade Credit

| | | |
|-----------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR I | 0,51 % | 0,45 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,51 % | 0,45 % |
| Thesaurierende Klasse USD X | 0,31 % | 0,25 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,19 % | 0,15 % |

Global Opportunistic Bond

| | | |
|------------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR I | 0,69 % | 0,50 % |
| Thesaurierende Klasse GBP P | 0,76 % | 0,48 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,01 % | 0,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,77 % | 0,50 % |
| Ausschüttende Klasse USD I | 0,78 % | 0,50 % |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 0,71 % | 0,44 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,47 % | 0,20 % |

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

Global Real Estate Securities

| Anteilklasse | Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht) |
|---|---|--|
| Thesaurierende Klasse EUR M | 3,24 % | 2,80 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert) | 0,83 % | 0,30 % |
| Thesaurierende Klasse GBP Z | 0,76 % | 0,30 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 2,24 % | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD CI | 3,26 % | 2,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 1,48 % | 1,05 % |
| Ausschüttende Klasse USD I5 | 1,02 % | 0,68 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 3,26 % | 2,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,76 % | 0,30 % |

Global Sustainable Equity

| | | |
|--|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) | 0,46 % | 0,46 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | 2,47 % | 2,47 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert) | 0,16 % | 0,16 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | 0,77 % | 0,77 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert) | 0,46 % | 0,46 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,66 % | 1,66 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,76 % | 0,76 % |
| Ausschüttende Klasse USD I | 0,75 % | 0,75 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 2,46 % | 2,46 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,16 % | 0,16 % |

Global Sustainable Value

| | | |
|--|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR M | 2,18 % | 2,00 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert) | 0,69 % | 0,52 % |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | 0,88 % | 0,73 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,38 % | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,93 % | 0,75 % |
| Thesaurierende Klasse USD I3 | 0,79 % | 0,62 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,48 % | 0,30 % |

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

High Yield Bond

| Anteilklasse | Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht) |
|--|---|--|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | 1,31 % | 1,31 % |
| Thesaurierende Klasse AUD A | 1,31 % | 1,31 % |
| Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) | 2,91 % | 2,91 % |
| Thesaurierende Klasse AUD B | 2,91 % | 2,91 % |
| Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich) | 2,90 % | 2,90 % |
| Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) | 2,91 % | 2,91 % |
| Thesaurierende Klasse AUD E | 2,91 % | 2,91 % |
| Ausschüttende Klasse AUD I | 0,71 % | 0,71 % |
| Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) | 1,91 % | 1,91 % |
| Ausschüttende Klasse AUD T (Wöchentlich) | 1,91 % | 1,91 % |
| Thesaurierende Klasse AUD T | 1,91 % | 1,91 % |
| Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich) | 1,31 % | 1,31 % |
| Thesaurierende Klasse CHF A | 1,31 % | 1,31 % |
| Thesaurierende Klasse CHF I | 0,70 % | 0,70 % |
| Thesaurierende Klasse CHF I2 | 0,61 % | 0,61 % |
| Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) | 1,31 % | 1,31 % |
| Ausschüttende Klasse CNY I (Monatlich) | 0,70 % | 0,70 % |
| Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) | 1,31 % | 1,31 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 1,31 % | 1,31 % |
| Ausschüttende Klasse EUR A | 1,31 % | 1,31 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 0,71 % | 0,71 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I | 0,71 % | 0,71 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 0,61 % | 0,61 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I2 | 0,61 % | 0,61 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 1,91 % | 1,91 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Z | 0,11 % | 0,11 % |
| Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich) | 1,31 % | 1,31 % |
| Thesaurierende Klasse GBP A | 1,31 % | 1,31 % |
| Ausschüttende Klasse GBP A | 1,31 % | 1,31 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I | 0,71 % | 0,71 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I | 0,71 % | 0,71 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I2 | 0,61 % | 0,61 % |

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

High Yield Bond (Fortsetzung)

| Anteilklasse | Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht) |
|--|---|--|
| Ausschüttende Klasse GBP I2 | 0,61 % | 0,61 % |
| Thesaurierende Klasse GBP Z | 0,11 % | 0,11 % |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) | 1,31 % | 1,31 % |
| Thesaurierende Klasse SEK A | 1,29 % | 1,29 % |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 1,31 % | 1,31 % |
| Thesaurierende Klasse SGD A | 1,31 % | 1,31 % |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,31 % | 1,31 % |
| Ausschüttende Klasse USD A (Wöchentlich) | 1,31 % | 1,31 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,31 % | 1,31 % |
| Ausschüttende Klasse USD A | 1,31 % | 1,31 % |
| Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) | 2,91 % | 2,91 % |
| Thesaurierende Klasse USD B | 2,91 % | 2,91 % |
| Thesaurierende Klasse USD C | 1,91 % | 1,91 % |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 2,31 % | 2,31 % |
| Ausschüttende Klasse USD C1 | 2,31 % | 2,31 % |
| Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich) | 2,90 % | 2,90 % |
| Thesaurierende Klasse USD C2 | 2,90 % | 2,90 % |
| Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) | 2,91 % | 2,91 % |
| Thesaurierende Klasse USD E | 2,91 % | 2,91 % |
| Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) | 0,71 % | 0,71 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,71 % | 0,71 % |
| Ausschüttende Klasse USD I | 0,71 % | 0,71 % |
| Ausschüttende Klasse USD I2 (Monatlich) | 0,61 % | 0,61 % |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 0,61 % | 0,61 % |
| Ausschüttende Klasse USD I2 | 0,61 % | 0,61 % |
| Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich) | 0,47 % | 0,47 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 1,91 % | 1,91 % |
| Ausschüttende Klasse USD M | 1,91 % | 1,91 % |
| Thesaurierende Klasse USD P | 0,68 % | 0,68 % |
| Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) | 1,91 % | 1,91 % |
| Ausschüttende Klasse USD T (Wöchentlich) | 1,91 % | 1,91 % |
| Thesaurierende Klasse USD T | 1,91 % | 1,91 % |

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

High Yield Bond (Fortsetzung)

| Anteilklasse | Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht) |
|---|---|--|
| Ausschüttende Klasse USD U (Monatlich) | 1,01 % | 1,01 % |
| Thesaurierende Klasse USD U | 1,01 % | 1,01 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,11 % | 0,11 % |
| Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich) | 2,91 % | 2,91 % |
| Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich) | 2,90 % | 2,90 % |
| Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) | 2,91 % | 2,91 % |
| Thesaurierende Klasse ZAR E | 2,91 % | 2,91 % |
| Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) | 1,91 % | 1,91 % |
| Thesaurierende Klasse ZAR T | 1,91 % | 1,91 % |

InnovAsia 5G

| | | |
|---|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse CHF I4 | 1,58 % | 0,71 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 2,99 % | 1,90 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I4 | 1,60 % | 0,71 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | 3,56 % | 2,70 % |
| Thesaurierende Klasse EUR X | 2,51 % | 1,65 % |
| Thesaurierende Klasse SGD A | 2,76 % | 1,90 % |
| Thesaurierende Klasse SGD I4 | 1,57 % | 0,71 % |
| Thesaurierende Klasse SGD X | 2,51 % | 1,65 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 2,46 % | 1,90 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 1,85 % | 1,05 % |
| Thesaurierende Klasse USD I4 | 1,61 % | 0,71 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 3,56 % | 2,70 % |
| Thesaurierende Klasse USD X | 2,57 % | 1,65 % |

Japan Equity Engagement

| | | |
|--|--------|--------|
| Ausschüttende Klasse EUR I5 | 0,56 % | 0,56 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 | 0,60 % | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert) | 0,67 % | 0,67 % |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | 1,06 % | 1,06 % |
| Thesaurierende Klasse JPY I | 1,03 % | 1,03 % |
| Ausschüttende Klasse JPY I | 0,98 % | 0,98 % |

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

Japan Equity Engagement (Fortsetzung)

| Anteilklasse | Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht) |
|------------------------------|---|--|
| Thesaurierende Klasse JPY I5 | 0,61 % | 0,61 % |
| Thesaurierende Klasse JPY Z | 0,16 % | 0,16 % |

Macro Opportunities FX

| | | |
|-----------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR I | 2,53 % | 0,80 % |
| Thesaurierende Klasse GBP Z | 1,23 % | 0,20 % |
| Thesaurierende Klasse SEK I | 1,39 % | 0,80 % |
| Ausschüttende Klasse SEK I | 1,96 % | 0,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 2,43 % | 0,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,58 % | 0,20 % |

Next Generation Mobility

| | | |
|---|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR A | 1,88 % | 1,88 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 1,02 % | 1,02 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | 1,03 % | 1,03 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | 2,68 % | 2,68 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,88 % | 1,88 % |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 2,88 % | 2,88 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 1,03 % | 1,03 % |
| Ausschüttende Klasse USD I | 1,03 % | 1,03 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 2,68 % | 2,68 % |
| Thesaurierende Klasse USD X | 1,73 % | 1,73 % |

Next Generation Space Economy²

| | | |
|--|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert) | 1,48 % | 0,80 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | 3,33 % | 2,70 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 1,79 % | 1,05 % |

Responsible Asian Debt – Hard Currency

| | | |
|--|--------|--------|
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,78 % | 1,35 % |
|--|--------|--------|

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

Responsible Asian Debt – Hard Currency (Fortsetzung)

| Anteilklasse | Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht) |
|---|---|--|
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,78 % | 1,35 % |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 2,79 % | 2,35 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 1,19 % | 0,75 % |
| Ausschüttende Klasse USD I | 1,28 % | 0,75 % |
| Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich) | 0,96 % | 0,51 % |
| Thesaurierende Klasse USD I4 | 0,95 % | 0,50 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 2,37 % | 1,95 % |
| Ausschüttende Klasse USD X (Monatlich) | 1,70 % | 1,25 % |
| Thesaurierende Klasse USD X | 1,68 % | 1,25 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,53 % | 0,15 % |

Short Duration Emerging Market Debt

| | | |
|--|--------|--------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | 1,07 % | 1,07 % |
| Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich) | 1,07 % | 1,07 % |
| Thesaurierende Klasse CHF A | 1,07 % | 1,07 % |
| Ausschüttende Klasse CHF A | 1,07 % | 1,07 % |
| Thesaurierende Klasse CHF I | 0,57 % | 0,57 % |
| Ausschüttende Klasse CHF I | 0,57 % | 0,57 % |
| Thesaurierende Klasse CHF I2 | 0,47 % | 0,47 % |
| Ausschüttende Klasse CHF I2 | 0,47 % | 0,47 % |
| Thesaurierende Klasse CHF I5 | 0,32 % | 0,32 % |
| Thesaurierende Klasse CHF P | 0,55 % | 0,55 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 1,07 % | 1,07 % |
| Ausschüttende Klasse EUR A | 1,07 % | 1,07 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 0,57 % | 0,57 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I | 0,57 % | 0,57 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 0,47 % | 0,47 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I2 | 0,47 % | 0,47 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 0,32 % | 0,32 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 1,67 % | 1,67 % |
| Ausschüttende Klasse EUR M | 1,68 % | 1,68 % |
| Thesaurierende Klasse EUR P | 0,55 % | 0,55 % |
| Thesaurierende Klasse EUR U | 0,82 % | 0,82 % |

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

| Anteilklasse | Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht) |
|--|---|--|
| Ausschüttende Klasse EUR X | 0,47 % | 0,47 % |
| Thesaurierende Klasse GBP A | 1,07 % | 1,07 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I | 0,57 % | 0,57 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I | 0,57 % | 0,57 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I2 | 0,47 % | 0,47 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I2 | 0,47 % | 0,47 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I5 | 0,33 % | 0,33 % |
| Thesaurierende Klasse GBP P | 0,56 % | 0,56 % |
| Thesaurierende Klasse JPY I | 0,57 % | 0,57 % |
| Ausschüttende Klasse JPY I | 0,57 % | 0,57 % |
| Thesaurierende Klasse SEK A | 1,07 % | 1,07 % |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 1,08 % | 1,08 % |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,08 % | 1,08 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,07 % | 1,07 % |
| Ausschüttende Klasse USD A | 1,07 % | 1,07 % |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 2,07 % | 2,07 % |
| Ausschüttende Klasse USD C1 | 2,07 % | 2,07 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,57 % | 0,57 % |
| Ausschüttende Klasse USD I | 0,58 % | 0,58 % |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 0,47 % | 0,47 % |
| Ausschüttende Klasse USD I2 | 0,47 % | 0,47 % |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 0,32 % | 0,32 % |
| Ausschüttende Klasse USD I5 | 0,32 % | 0,32 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 1,67 % | 1,67 % |
| Ausschüttende Klasse USD M | 1,67 % | 1,67 % |
| Thesaurierende Klasse USD P | 0,55 % | 0,55 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,08 % | 0,08 % |

Short Duration High Yield SDG Engagement

| | | |
|--|--------|--------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | 1,32 % | 1,32 % |
| Thesaurierende Klasse CHF A | 1,32 % | 1,32 % |
| Thesaurierende Klasse CHF I | 0,72 % | 0,72 % |

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

| Anteilklasse | Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht) |
|--|---|--|
| Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) | 1,32 % | 1,32 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 1,32 % | 1,32 % |
| Ausschüttende Klasse EUR A | 1,32 % | 1,32 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 0,72 % | 0,72 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 0,62 % | 0,62 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 1,92 % | 1,92 % |
| Ausschüttende Klasse EUR M | 1,92 % | 1,92 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I | 0,70 % | 0,70 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I | 0,73 % | 0,73 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I2 | 0,62 % | 0,62 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I2 | 0,62 % | 0,62 % |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) | 1,32 % | 1,32 % |
| Thesaurierende Klasse JPY I | 0,72 % | 0,72 % |
| Ausschüttende Klasse JPY I | 0,72 % | 0,72 % |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 1,32 % | 1,32 % |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,32 % | 1,32 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,32 % | 1,32 % |
| Ausschüttende Klasse USD A | 1,32 % | 1,32 % |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 2,32 % | 2,32 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,72 % | 0,72 % |
| Ausschüttende Klasse USD I | 0,73 % | 0,73 % |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 0,60 % | 0,60 % |
| Ausschüttende Klasse USD I2 | 0,61 % | 0,61 % |
| Thesaurierende Klasse USD I4 | 0,49 % | 0,49 % |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 0,42 % | 0,42 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 1,91 % | 1,91 % |
| Ausschüttende Klasse USD M | 1,91 % | 1,91 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,12 % | 0,12 % |
| Strategic Income | | |
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | 1,11 % | 1,11 % |
| Ausschüttende Klasse AUD Z (Monatlich) | 0,11 % | 0,11 % |

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

Strategic Income (Fortsetzung)

| Anteilklasse | Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht) |
|---|---|--|
| Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) | 1,13 % | 1,13 % |
| Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) | 1,11 % | 1,11 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 1,11 % | 1,11 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 0,60 % | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 1,71 % | 1,71 % |
| Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich) | 1,11 % | 1,11 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I (Monatlich) | 0,66 % | 0,66 % |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) | 1,11 % | 1,11 % |
| Thesaurierende Klasse JPY I | 0,61 % | 0,61 % |
| Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert) | 0,61 % | 0,61 % |
| Ausschüttende Klasse JPY I CG | 0,61 % | 0,61 % |
| Ausschüttende Klasse JPY I | 0,60 % | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse JPY Z | 0,11 % | 0,11 % |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 1,11 % | 1,11 % |
| Thesaurierende Klasse SGD A | 1,11 % | 1,11 % |
| Ausschüttende Klasse SGD I (Monatlich) | 0,61 % | 0,61 % |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,11 % | 1,11 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,11 % | 1,11 % |
| Ausschüttende Klasse USD A | 1,11 % | 1,11 % |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 2,11 % | 2,11 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,61 % | 0,61 % |
| Ausschüttende Klasse USD I | 0,61 % | 0,61 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 1,71 % | 1,71 % |
| Ausschüttende Klasse USD M | 1,71 % | 1,71 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,11 % | 0,11 % |

Sustainable Asia High Yield

| | | |
|--|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR X | 1,08 % | 0,55 % |
| Thesaurierende Klasse GBP X | 1,09 % | 0,55 % |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,87 % | 1,40 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,87 % | 1,40 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 1,27 % | 0,80 % |

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

Sustainable Asia High Yield (Fortsetzung)

| Anteilklasse | Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht) |
|-----------------------------|---|--|
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,67 % | 0,20 % |
| Ausschüttende Klasse USD Z | 0,67 % | 0,20 % |

Sustainable Emerging Market Corporate Debt

| | | |
|--|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse CHF I | 1,14 % | 1,00 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 1,93 % | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 1,14 % | 1,00 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I3 | 0,82 % | 0,68 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 2,74 % | 2,60 % |
| Ausschüttende Klasse EUR M | 2,74 % | 2,60 % |
| Thesaurierende Klasse EUR X | 0,80 % | 0,58 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I | 1,13 % | 1,00 % |
| Thesaurierende Klasse SEK A | 1,94 % | 1,80 % |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,94 % | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,94 % | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 2,94 % | 2,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 1,14 % | 1,00 % |
| Ausschüttende Klasse USD I | 1,14 % | 1,00 % |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 0,97 % | 0,84 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 2,74 % | 2,60 % |
| Ausschüttende Klasse USD M | 2,74 % | 2,60 % |

Sustainable Emerging Market Debt – Hard Currency²

| | | |
|------------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR I3 | 0,59 % | 0,59 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I4 | 0,51 % | 0,51 % |
| Thesaurierende Klasse EUR X | 0,45 % | 0,45 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,78 % | 0,78 % |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 0,45 % | 0,45 % |

Tactical Macro¹

| | | |
|------------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse USD I | 1,36 % | 1,00 % |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 0,91 % | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,53 % | 0,20 % |

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

Ultra Short Term Euro Bond

| Anteilklasse | Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht) |
|------------------------------|---|--|
| Thesaurierende Klasse CHF P | 0,26 % | 0,26 % |
| Thesaurierende Klasse CHF U | 0,37 % | 0,37 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 0,46 % | 0,46 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 0,27 % | 0,27 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I | 0,27 % | 0,27 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 0,23 % | 0,23 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 0,17 % | 0,17 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 0,66 % | 0,66 % |
| Thesaurierende Klasse EUR U | 0,37 % | 0,37 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Z | 0,08 % | 0,08 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,27 % | 0,27 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,08 % | 0,08 % |

Uncorrelated Strategies

| | | |
|------------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse CHF I | 1,69 % | 1,69 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 2,43 % | 2,43 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 1,65 % | 1,65 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 1,54 % | 1,54 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 3,24 % | 3,24 % |
| Thesaurierende Klasse EUR P | 1,60 % | 1,60 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I | 1,63 % | 1,63 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I2 | 1,55 % | 1,55 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I2 | 1,59 % | 1,56 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 | 1,30 % | 1,30 % |
| Thesaurierende Klasse GBP P | 1,66 % | 1,66 % |
| Thesaurierende Klasse GBP Z | 0,95 % | 0,95 % |
| Thesaurierende Klasse JPY I | 1,70 % | 1,70 % |
| Thesaurierende Klasse SGD A | 1,78 % | 1,70 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 2,44 % | 2,44 % |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 3,45 % | 3,45 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 1,70 % | 1,70 % |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 1,55 % | 1,55 % |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 1,33 % | 1,33 % |

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

| Anteilklasse | Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht) |
|-----------------------------|---|--|
| Thesaurierende Klasse USD M | 3,24 % | 3,24 % |
| Thesaurierende Klasse USD P | 1,64 % | 1,64 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,94 % | 0,94 % |

US Equity

| | | |
|------------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse JPY I3 | 0,91 % | 0,72 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,89 % | 1,70 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 1,14 % | 0,95 % |
| Ausschüttende Klasse USD I | 1,14 % | 0,95 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 2,71 % | 2,50 % |

US Equity Index PutWrite

| | | |
|--|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR I | 0,71 % | 0,71 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I3 | 0,52 % | 0,52 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I4 | 0,46 % | 0,46 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I4 | 0,45 % | 0,45 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 2,10 % | 2,10 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | 0,70 % | 0,70 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I3 | 0,52 % | 0,52 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I3 | 0,52 % | 0,52 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert) | 0,51 % | 0,51 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) | 0,46 % | 0,46 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I4 | 0,47 % | 0,47 % |
| Ausschüttende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | 0,67 % | 0,67 % |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 1,30 % | 1,30 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,30 % | 1,30 % |
| Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) | 0,69 % | 0,69 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,70 % | 0,70 % |
| Ausschüttende Klasse USD I3 | 0,52 % | 0,52 % |
| Thesaurierende Klasse USD I4 | 0,46 % | 0,46 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 2,10 % | 2,10 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,10 % | 0,10 % |

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

US Large Cap Value

| Anteilklasse | Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht) |
|--|---|--|
| Thesaurierende Klasse EUR A | 1,58 % | 1,58 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) | 1,57 % | 1,57 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 0,78 % | 0,78 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | 0,78 % | 0,78 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) | 0,50 % | 0,50 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) | 0,43 % | 0,43 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I | 0,77 % | 0,77 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | 0,79 % | 0,79 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I | 0,79 % | 0,79 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | 0,78 % | 0,78 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) | 0,50 % | 0,50 % |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | 0,75 % | 0,75 % |
| Ausschüttende Klasse GBP P | 0,73 % | 0,73 % |
| Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert) | 0,71 % | 0,71 % |
| Ausschüttende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert) | 0,71 % | 0,71 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,58 % | 1,58 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,78 % | 0,78 % |
| Ausschüttende Klasse USD I4 | 0,50 % | 0,50 % |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 0,42 % | 0,42 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 2,37 % | 2,37 % |
| Thesaurierende Klasse USD Y | 0,73 % | 0,73 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,07 % | 0,07 % |

US Long Short Equity

| | | |
|----------------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR A | 2,43 % | 2,43 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 1,51 % | 1,51 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I3 | 1,14 % | 1,14 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 3,24 % | 3,24 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I3 | 1,15 % | 1,15 % |
| Thesaurierende Klasse SGD A1 | 2,04 % | 2,04 % |
| Thesaurierende Klasse USD A (PF) | 1,89 % | 1,89 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 2,44 % | 2,44 % |

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

US Long Short Equity (Fortsetzung)

| Anteilklasse | Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht) |
|---------------------------------|---|--|
| Thesaurierende Klasse USD A1 | 2,04 % | 2,04 % |
| Ausschüttende Klasse USD I (PF) | 1,19 % | 1,19 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 1,53 % | 1,53 % |
| Thesaurierende Klasse USD I3 | 1,13 % | 1,13 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 3,24 % | 3,24 % |
| Thesaurierende Klasse USD U | 1,98 % | 1,98 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,19 % | 0,19 % |

US Multi Cap Opportunities

| | | |
|---|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse AUD E | 2,98 % | 2,98 % |
| Thesaurierende Klasse AUD T | 1,98 % | 1,98 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I3 | 0,68 % | 0,68 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 2,88 % | 2,88 % |
| Thesaurierende Klasse EUR1 A | 1,88 % | 1,88 % |
| Thesaurierende Klasse EUR1 I | 1,03 % | 1,03 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert) | 0,67 % | 0,67 % |
| Thesaurierende Klasse SGD A | 1,88 % | 1,88 % |
| Thesaurierende Klasse USD B | 2,98 % | 2,98 % |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 2,88 % | 2,88 % |
| Thesaurierende Klasse USD C2 | 2,97 % | 2,97 % |
| Thesaurierende Klasse USD E | 2,98 % | 2,98 % |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 0,84 % | 0,84 % |
| Thesaurierende Klasse USD I3 | 0,68 % | 0,68 % |
| Ausschüttende Klasse USD I3 | 0,68 % | 0,68 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 2,88 % | 2,88 % |
| Thesaurierende Klasse USD T | 1,98 % | 1,98 % |
| Thesaurierende Klasse USD U | 1,43 % | 1,43 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,18 % | 0,18 % |
| Thesaurierende Klasse USD1 A | 1,88 % | 1,88 % |
| Thesaurierende Klasse USD1 I | 1,03 % | 1,03 % |
| Ausschüttende Klasse USD1 I | 1,03 % | 1,03 % |
| Thesaurierende Klasse ZAR B | 2,98 % | 2,98 % |

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

| Anteilklasse | Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht) |
|------------------------------|---|--|
| Thesaurierende Klasse ZAR C2 | 2,96 % | 2,96 % |
| Thesaurierende Klasse ZAR E | 2,98 % | 2,98 % |
| Thesaurierende Klasse ZAR T | 1,98 % | 1,98 % |

US Real Estate Securities

| | | |
|--|--------|--------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | 1,70 % | 1,70 % |
| Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) | 2,99 % | 2,99 % |
| Thesaurierende Klasse AUD B | 2,99 % | 2,99 % |
| Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) | 2,99 % | 2,99 % |
| Thesaurierende Klasse AUD E | 3,00 % | 3,00 % |
| Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) | 1,99 % | 1,99 % |
| Thesaurierende Klasse AUD T | 1,99 % | 1,99 % |
| Thesaurierende Klasse CHF A | 1,69 % | 1,69 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 1,69 % | 1,69 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 0,94 % | 0,94 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 2,69 % | 2,69 % |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) | 1,69 % | 1,69 % |
| Thesaurierende Klasse SGD A | 1,69 % | 1,69 % |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,69 % | 1,69 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,69 % | 1,69 % |
| Ausschüttende Klasse USD A | 1,69 % | 1,69 % |
| Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) | 2,99 % | 2,99 % |
| Thesaurierende Klasse USD B | 2,99 % | 2,99 % |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 2,69 % | 2,69 % |
| Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) | 2,99 % | 2,99 % |
| Thesaurierende Klasse USD E | 2,99 % | 2,99 % |
| Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) | 0,94 % | 0,94 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,94 % | 0,94 % |
| Ausschüttende Klasse USD I | 0,94 % | 0,94 % |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 0,73 % | 0,73 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 2,69 % | 2,69 % |
| Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) | 1,99 % | 1,99 % |

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

| Anteilklasse | Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht) |
|--|---|--|
| Thesaurierende Klasse USD T | 1,99 % | 1,99 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,20 % | 0,20 % |
| Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich) | 2,99 % | 2,99 % |
| Thesaurierende Klasse ZAR B | 2,99 % | 2,99 % |
| Thesaurierende Klasse ZAR C2 | 2,99 % | 2,99 % |
| Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) | 2,99 % | 2,99 % |
| Thesaurierende Klasse ZAR E | 2,99 % | 2,99 % |
| Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) | 1,99 % | 1,99 % |
| Thesaurierende Klasse ZAR T | 1,99 % | 1,99 % |

US Small Cap

| | | |
|--|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse AUD B | 2,93 % | 2,93 % |
| Thesaurierende Klasse AUD C2 | 2,88 % | 2,88 % |
| Thesaurierende Klasse AUD E | 2,93 % | 2,93 % |
| Thesaurierende Klasse AUD T | 1,93 % | 1,93 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 1,83 % | 1,83 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) | 1,82 % | 1,82 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 0,98 % | 0,98 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | 0,98 % | 0,98 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert) | 0,81 % | 0,81 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) | 0,64 % | 0,64 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 2,83 % | 2,83 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Z | 0,13 % | 0,13 % |
| Ausschüttende Klasse JPY I | 0,98 % | 0,98 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,83 % | 1,83 % |
| Ausschüttende Klasse USD A | 1,83 % | 1,83 % |
| Thesaurierende Klasse USD B | 2,93 % | 2,93 % |
| Thesaurierende Klasse USD C2 | 2,88 % | 2,88 % |
| Thesaurierende Klasse USD E | 2,93 % | 2,93 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,98 % | 0,98 % |
| Ausschüttende Klasse USD I | 0,98 % | 0,98 % |
| Thesaurierende Klasse USD I3 | 0,73 % | 0,73 % |

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

US Small Cap (Fortsetzung)

| Anteilklasse | Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht) |
|-----------------------------|---|--|
| Thesaurierende Klasse USD M | 2,83 % | 2,83 % |
| Thesaurierende Klasse USD T | 1,93 % | 1,93 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,13 % | 0,13 % |
| Thesaurierende Klasse ZAR E | 2,93 % | 2,93 % |
| Thesaurierende Klasse ZAR T | 1,93 % | 1,93 % |

US Small Cap Intrinsic Value

| | | |
|--|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | 0,98 % | 0,98 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I2 (nicht währungsgesichert) | 0,81 % | 0,81 % |
| Thesaurierende Klasse JPY I3 (nicht währungsgesichert) | 0,77 % | 0,77 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 1,83 % | 1,83 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,98 % | 0,98 % |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 0,81 % | 0,81 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 2,82 % | 2,82 % |

¹ Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtszeitraum aufgelegt.

² Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

Anhang II

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT)

5G Connectivity

| Anteilklasse | Auflegungsdatum | ISIN | Geschäftsjahr zum 31. Dezember | | |
|---|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
| | | | 2021 % | 2022 % | 2023 % |
| Thesaurierende Klasse AUD A | 20.05.2020 | IE00BMPRXT94 | 3,58 | (45,90) | 34,96 |
| Thesaurierende Klasse AUD I2 | 13.09.2023 | IE0002QWGC08 | – | – | 13,20 |
| Thesaurierende Klasse CHF A | 01.08.2023 | IE00BMY47772 | – | – | 6,20 |
| Thesaurierende Klasse CHF I | 01.08.2023 | IE00BMY47665 | – | – | 6,50 |
| Thesaurierende Klasse CHF I2 | 13.09.2023 | IE0003BXX5E5 | – | – | 13,70 |
| Thesaurierende Klasse CNY A | 01.02.2021 | IE00BN13NY36 | 1,38 | (43,77) | 34,20 |
| Thesaurierende Klasse CNY I2 | 13.09.2023 | IE000VZM9Z74 | – | – | 13,42 |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 13.05.2020 | IE00BMPRXP56 | 3,43 | (45,94) | 34,86 |
| Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) | 22.04.2020 | IE00BMD7ZB71 | 12,60 | (39,94) | 33,62 |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 30.06.2020 | IE00BMPRXW24 | 4,27 | (45,41) | 35,83 |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | 12.06.2020 | IE00BLLXGX96 | 13,51 | (39,41) | 34,74 |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 13.09.2023 | IE00049FOE96 | – | – | 13,20 |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 01.09.2020 | IE00BMPRXV17 | 4,69 | (45,20) | 36,44 |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | 22.04.2020 | IE00BLLXH031 | 11,65 | (40,38) | 32,49 |
| Thesaurierende Klasse GBP A | 15.05.2020 | IE00BMPRXS87 | 3,98 | (45,24) | 36,92 |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | 02.11.2020 | IE00BKS9L945 | 6,46 | (35,98) | 31,63 |
| Thesaurierende Klasse GBP I2 | 13.09.2023 | IE000MHA92L4 | – | – | 13,70 |
| Thesaurierende Klasse HKD A | 13.05.2020 | IE00BMPRXQ63 | 4,46 | (43,95) | 36,82 |
| Thesaurierende Klasse HKD I2 | 13.09.2023 | IE000ZWJU5Z2 | – | – | 13,90 |
| Thesaurierende Klasse SGD A | 14.05.2020 | IE00BMPRXR70 | 4,19 | (44,38) | 35,90 |
| Thesaurierende Klasse SGD I2 | 13.09.2023 | IE000V6EVRT1 | – | – | 13,35 |
| Thesaurierende Klasse USD A | 04.05.2020 | IE00BMPRXN33 | 4,59 | (43,60) | 38,16 |
| Thesaurierende Klasse USD E | 01.02.2023 | IE000ZUB0R86 | – | – | 19,20 |
| Thesaurierende Klasse USD I | 08.04.2020 | IE00BLLXGV72 | 5,51 | (43,15) | 39,43 |
| Ausschüttende Klasse USD I | 08.04.2020 | IE00BLLXGW89 | 5,52 | (43,11) | 39,43 |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 10.03.2021 | IE00BLR75G15 | 9,80 | (42,99) | 39,62 |
| Thesaurierende Klasse USD I3 | 06.11.2020 | IE00BNC26Z17 | 5,80 | (43,02) | 39,85 |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 07.05.2020 | IE00BLLXGY04 | 5,93 | (42,92) | 40,02 |
| Thesaurierende Klasse USD M | 02.06.2020 | IE00BMCTKC00 | 3,68 | (44,05) | 37,06 |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 19.03.2021 | IE00BMG4Q780 | 8,80 | (42,65) | 40,71 |
| Thesaurierende Klasse ZAR A | 14.02.2023 | IE0009UHWAU4 | – | – | 25,63 |
| Thesaurierende Klasse ZAR E | 10.02.2023 | IE000CS9U7B7 | – | – | 26,25 |

China A-Share Equity

| | | | | | |
|---|------------|--------------|------|---------|---------|
| Thesaurierende Klasse CNY I | 28.07.2020 | IE00BLPHVV04 | 0,20 | (22,68) | (12,31) |
| Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) | 28.07.2020 | IE00BMD7Z068 | 2,35 | (28,89) | (14,87) |
| Ausschüttende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) | 28.07.2020 | IE00BMD7Z175 | 2,35 | (28,97) | (14,81) |

China Bond

| | | | | | |
|--|------------|--------------|--------|--------|------|
| Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) | 04.11.2020 | IE00BF4ZPF56 | (0,72) | (6,70) | 2,70 |
| Ausschüttende Klasse CNY I | 12.12.2022 | IE00BYRQMQ22 | (0,05) | (6,13) | 3,39 |

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

China Bond (Fortsetzung)

| Anteilklasse | Auflegungsdatum | ISIN | Geschäftsjahr zum 31. Dezember | | |
|--|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
| | | | 2021 % | 2022 % | 2023 % |
| Thesaurierende Klasse CNY Z | 08.09.2015 | IE00BYRGQQ69 | 0,60 | (5,51) | 4,05 |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 01.12.2020 | IE00BN13NX29 | (5,48) | – | – |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | 20.02.2020 | IE00BL1NNM70 | 9,83 | – | – |
| Thesaurierende Klasse GBP I2 | 09.02.2021 | IE00BNC26Y00 | (3,10) | (7,12) | 5,67 |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) (nicht währungsgesichert) | 12.03.2019 | IE00BHXGRN56 | 3,49 | (14,73) | (1,88) |
| Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) | 08.09.2015 | IE00BYQX7571 | 2,07 | (13,76) | 0,49 |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 29.03.2019 | IE00BYRGQJ92 | (2,13) | (6,32) | 6,85 |
| Thesaurierende Klasse USD Z (nicht währungsgesichert) | 10.04.2018 | IE00BYRGQN39 | 2,74 | (13,14) | 1,02 |

China Equity

| | | | | | |
|---|------------|--------------|--------|---------|---------|
| Thesaurierende Klasse CHF I | 31.07.2015 | IE00B63FQV68 | (7,10) | (24,04) | (25,51) |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 14.07.2009 | IE00B54BK812 | (7,67) | (24,30) | (24,71) |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 14.07.2009 | IE00B54BLX33 | (7,00) | (23,71) | (24,17) |
| Thesaurierende Klasse EUR Z | 03.06.2014 | IE00BKJ9MV22 | (5,96) | (22,86) | (23,31) |
| Ausschüttende Klasse GBP A | 21.05.2015 | IE00BWB9BT54 | (7,17) | (23,19) | (23,54) |
| Ausschüttende Klasse GBP I2 (nicht währungsgesichert) | 23.06.2014 | IE00BMN94C76 | (4,93) | – | – |
| Thesaurierende Klasse SGD A | 01.12.2014 | IE00B5MMRT66 | (7,00) | (22,69) | (24,12) |
| Thesaurierende Klasse USD A | 14.07.2009 | IE00B543WZ88 | (6,70) | (21,93) | (22,83) |
| Ausschüttende Klasse USD A | 27.08.2014 | IE00BPRC5H50 | (6,67) | (21,94) | (22,81) |
| Thesaurierende Klasse USD I | 14.07.2009 | IE00B547N797 | (6,01) | (21,33) | (22,22) |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 11.08.2014 | IE00B8BYOV78 | (5,80) | (21,13) | (22,05) |
| Thesaurierende Klasse USD M | 27.05.2016 | IE00BYVF7440 | (7,63) | (22,70) | (23,52) |
| Thesaurierende Klasse USD U | 27.06.2014 | IE00BLS6051 | (6,31) | (21,63) | (22,48) |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 01.08.2014 | IE00BKJ9MZ69 | (4,94) | (20,48) | (21,35) |

Climate Innovation¹

| | | | | | |
|------------------------------|------------|--------------|---|---|--------|
| Thesaurierende Klasse USD A | 01.08.2023 | IE0006EGSTJ7 | – | – | (3,40) |
| Thesaurierende Klasse USD I | 01.08.2023 | IE000UGESYW1 | – | – | (3,00) |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 01.08.2023 | IE000YMVHC49 | – | – | (2,90) |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 01.08.2023 | IE0009Q8TA55 | – | – | (2,70) |

CLO Income

| | | | | | |
|-----------------------------|------------|--------------|------|--------|-------|
| Thesaurierende Klasse EUR A | 09.06.2022 | IE000BKR2PI0 | – | (3,30) | 18,30 |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 12.07.2018 | IE00BG7PQ018 | 6,56 | (8,74) | 19,26 |
| Ausschüttende Klasse EUR I2 | 15.11.2018 | IE00BD102V45 | 6,73 | (8,68) | 19,33 |
| Ausschüttende Klasse GBP I2 | 15.11.2018 | IE00BD102W51 | 7,49 | (7,13) | – |
| Ausschüttende Klasse GBP I5 | 12.07.2018 | IE00BD5KHL59 | 7,72 | – | – |
| Thesaurierende Klasse GBP Z | 12.12.2019 | IE00BHR46W74 | 8,11 | (6,55) | 20,76 |
| Thesaurierende Klasse SEK I | 12.07.2018 | IE00BG7P3L15 | 7,04 | (8,25) | 19,37 |
| Thesaurierende Klasse USD A | 09.06.2022 | IE000I861U99 | – | (1,70) | 20,75 |

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

CLO Income (Fortsetzung)

| Anteilklasse | Auflegungsdatum | ISIN | Geschäftsjahr zum 31. Dezember | | |
|-----------------------------|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
| | | | 2021 % | 2022 % | 2023 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 12.07.2018 | IE00BF4NG566 | 7,51 | (6,91) | 21,72 |
| Ausschüttende Klasse USD I | 17.08.2023 | IE00BF4NG673 | – | – | 5,97 |
| Ausschüttende Klasse USD I2 | 21.03.2019 | IE00BHXGRM40 | 7,66 | (6,82) | 21,73 |
| Ausschüttende Klasse USD I5 | 12.07.2018 | IE00BG7P3H78 | 7,83 | (6,54) | 22,04 |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 18.04.2019 | IE00BG7PPZ91 | 8,37 | (6,26) | 22,72 |

Commodities²

| | | | | | |
|---|------------|--------------|---|---------|---------|
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | 14.12.2022 | IE000GZB3BM6 | – | 4,30 | (11,79) |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 | 29.03.2022 | IE00079M4LO1 | – | (5,80) | (7,22) |
| Thesaurierende Klasse USD A | 15.03.2022 | IE000407KK00 | – | (2,90) | (7,31) |
| Thesaurierende Klasse USD I | 09.02.2022 | IE000MVZ49F4 | – | 12,00 | (6,52) |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 04.03.2022 | IE0000TMDNF9 | – | (2,20) | (6,24) |
| Thesaurierende Klasse USD M | 14.04.2022 | IE000D1UZ4M5 | – | (10,90) | (7,86) |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 15.02.2022 | IE000K7ZYIB8 | – | 11,64 | (5,92) |

Corporate Hybrid Bond

| | | | | | |
|--|------------|--------------|--------|---------|-------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | 23.09.2016 | IE00BD5YX427 | 0,55 | (13,56) | 8,14 |
| Thesaurierende Klasse CHF P | 27.04.2017 | IE00BD4HOK73 | 0,36 | (14,46) | 6,22 |
| Ausschüttende Klasse CHF P | 17.06.2016 | IE00BDHBH834 | 0,37 | (14,47) | 6,09 |
| Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) | 18.07.2016 | IE00BDHBH727 | (0,05) | (14,72) | 7,57 |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 03.06.2016 | IE00BYV1RN13 | (0,08) | (14,66) | 7,53 |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 19.11.2015 | IE00BZ090894 | 0,55 | (14,13) | 8,14 |
| Ausschüttende Klasse EUR I | 19.11.2015 | IE00BZ090902 | 0,55 | (14,14) | 8,17 |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 03.02.2017 | IE00BYVF7770 | 0,59 | (14,00) | 8,24 |
| Ausschüttende Klasse EUR I2 | 24.12.2020 | IE00BD37NF41 | 0,59 | (14,03) | 8,24 |
| Thesaurierende Klasse EUR I3 | 13.09.2016 | IE00BD3H7K78 | 0,67 | (13,95) | 8,35 |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 19.11.2015 | IE00BZ090787 | 0,85 | (13,87) | 8,50 |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 18.02.2016 | IE00BD9WHQ23 | (0,70) | (15,13) | 6,80 |
| Ausschüttende Klasse EUR M | 13.02.2017 | IE00BZ0BMF67 | (0,62) | (15,17) | 6,90 |
| Thesaurierende Klasse EUR P | 27.04.2017 | IE00BYVF7663 | 0,61 | (14,14) | 8,23 |
| Ausschüttende Klasse EUR P | 24.06.2016 | IE00BD37ND27 | 0,49 | (14,05) | 8,07 |
| Thesaurierende Klasse GBP I | 09.03.2017 | IE00BYMJ8V99 | 1,17 | (12,75) | 9,87 |
| Thesaurierende Klasse GBP I2 | 15.05.2017 | IE00BDRKGS35 | 1,28 | (12,63) | 10,02 |
| Ausschüttende Klasse GBP I2 | 24.08.2016 | IE00BZCPRS46 | 1,28 | (12,63) | 9,95 |
| Thesaurierende Klasse GBP P | 16.08.2019 | IE00BH3W6W54 | 1,21 | (12,71) | 9,92 |
| Ausschüttende Klasse GBP P | 19.05.2017 | IE00BD4HOM97 | 1,23 | (12,77) | 9,96 |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 02.08.2019 | IE00BJR5T361 | 0,77 | (13,05) | 8,32 |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 18.07.2016 | IE00BDHBH610 | 0,74 | (12,77) | 9,73 |
| Thesaurierende Klasse USD A | 10.08.2016 | IE00BD0PCH68 | 0,79 | (12,79) | 9,75 |
| Ausschüttende Klasse USD A | 23.04.2021 | IE00BMT63Q97 | 0,22 | (12,83) | 9,67 |

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum 31. Dezember

| Anteilklasse | Auflegungsdatum | ISIN | Geschäftsjahr zum 31. Dezember | | |
|------------------------------|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
| | | | 2021 % | 2022 % | 2023 % |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 13.12.2017 | IE00BDFBJ677 | (0,27) | (13,67) | 8,70 |
| Thesaurierende Klasse USD I | 14.06.2016 | IE00BDHBH503 | 1,37 | (12,29) | 10,36 |
| Ausschüttende Klasse USD I | 23.04.2021 | IE00BMCFKY00 | 0,58 | (12,28) | 10,44 |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 03.02.2017 | IE00BDRKGR28 | 1,47 | (12,20) | 10,59 |
| Ausschüttende Klasse USD I2 | 03.02.2017 | IE00BD37NK93 | 1,45 | (12,20) | 10,45 |
| Thesaurierende Klasse USD M | 15.12.2017 | IE00BDFBLB65 | 0,09 | (13,36) | 9,13 |
| Ausschüttende Klasse USD M | 15.12.2017 | IE00BDFBJ784 | 0,15 | (13,35) | 9,01 |
| Thesaurierende Klasse USD P | 05.05.2017 | IE00BD4HOL80 | 1,46 | (12,28) | 10,36 |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 20.01.2017 | IE00BZ56PT19 | 1,98 | (11,77) | 11,06 |

Developed Market FMP – 2027¹

| | | | | | |
|-----------------------------|------------|--------------|---|---|------|
| Thesaurierende Klasse EUR A | 31.07.2023 | IE0006ZF3U01 | – | – | 3,10 |
| Ausschüttende Klasse EUR I | 15.09.2023 | IE000C576DF9 | – | – | 3,80 |
| Thesaurierende Klasse USD A | 31.07.2023 | IE000VQRCT01 | – | – | 3,80 |
| Ausschüttende Klasse USD A | 31.07.2023 | IE0000H8VV97 | – | – | 3,80 |
| Thesaurierende Klasse USD I | 31.07.2023 | IE000UVYX3U2 | – | – | 4,00 |
| Ausschüttende Klasse USD I | 21.08.2023 | IE000ZFOERE3 | – | – | 4,80 |
| Thesaurierende Klasse USD X | 31.07.2023 | IE000JGNBMI5 | – | – | 3,90 |
| Ausschüttende Klasse USD X | 31.07.2023 | IE000BKPP400 | – | – | 3,90 |

Emerging Market Debt - Hard Currency

| | | | | | |
|--|------------|--------------|--------|---------|-------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | 26.02.2019 | IE00BF0K7B44 | (4,41) | (20,61) | 11,27 |
| Ausschüttende Klasse AUD I | 26.05.2020 | IE00B986FB81 | (3,74) | (20,07) | 12,11 |
| Thesaurierende Klasse CAD I3 (nicht währungsgesichert) | 31.10.2022 | IE000ESKKWI7 | – | 10,40 | 11,05 |
| Thesaurierende Klasse CHF I2 | 13.01.2020 | IE00BKKL6823 | (4,39) | (21,12) | 9,31 |
| Thesaurierende Klasse CHF P | 24.01.2018 | IE00BFNPGF37 | (4,44) | (21,23) | 9,24 |
| Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) | 16.04.2018 | IE00B986FR42 | (5,06) | (21,52) | 10,37 |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 31.05.2013 | IE00B986FT65 | (4,93) | (21,63) | 10,49 |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 31.05.2013 | IE00B986G486 | (4,25) | (21,06) | 11,15 |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | 17.09.2019 | IE00BK5V1269 | 3,97 | (13,70) | 9,98 |
| Ausschüttende Klasse EUR I | 07.10.2016 | IE00B986GB56 | (4,36) | (21,04) | 11,36 |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 18.12.2019 | IE00B986GC63 | (4,14) | (20,98) | 11,44 |
| Ausschüttende Klasse EUR I2 | 06.11.2019 | IE00BK6H5655 | (4,16) | (21,02) | 11,56 |
| Thesaurierende Klasse EUR I3 | 29.07.2016 | IE00BD0PCJ82 | (4,12) | (20,88) | 11,44 |
| Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert) | 06.09.2019 | IE00BJ7VWB39 | 4,12 | (13,44) | – |
| Ausschüttende Klasse EUR I3 | 12.03.2019 | IE00BJ2JSZ87 | (4,09) | – | – |
| Thesaurierende Klasse EUR I4 | 10.12.2015 | IE00BXQ9CQ11 | (4,04) | (20,87) | 11,63 |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) | 05.07.2022 | IE000EFKIOA5 | – | 0,00 | 10,40 |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 18.02.2016 | IE00BSNLZN33 | (5,73) | (22,24) | 9,61 |
| Ausschüttende Klasse EUR M | 18.02.2016 | IE00BSNLZP56 | (5,75) | (22,23) | 9,68 |

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

| Anteilklasse | Auflegungsdatum | ISIN | Geschäftsjahr zum 31. Dezember | | |
|---|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
| | | | 2021 % | 2022 % | 2023 % |
| Thesaurierende Klasse EUR P | 23.01.2018 | IE00BFNPGG44 | (4,26) | (21,07) | 11,28 |
| Thesaurierende Klasse EUR Z | 29.12.2017 | IE00BKJB1B19 | (3,61) | (20,56) | 12,09 |
| Thesaurierende Klasse GBP I | 16.12.2016 | IE00BDDNB708 | (3,72) | (19,88) | 12,88 |
| Ausschüttende Klasse GBP I | 21.02.2018 | IE00BZ1D2402 | (3,73) | (19,86) | 12,97 |
| Thesaurierende Klasse GBP I2 | 26.01.2018 | IE00B986H344 | (3,60) | (19,71) | 12,99 |
| Ausschüttende Klasse GBP I2 | 06.07.2015 | IE00B986H450 | (3,60) | (19,77) | 13,28 |
| Thesaurierende Klasse GBP P | 14.03.2018 | IE00BFOV1041 | (3,70) | (19,85) | 12,97 |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) | 09.01.2019 | IE00BF0K7C50 | (4,16) | (19,74) | 11,87 |
| Thesaurierende Klasse JPY I | 11.12.2017 | IE00BD4H0D07 | (3,84) | (21,02) | 7,41 |
| Thesaurierende Klasse SEK A | 05.11.2015 | IE00BYSW3F11 | (4,71) | (21,55) | 10,56 |
| Thesaurierende Klasse SEK I (nicht währungsgesichert) | 14.04.2020 | IE00BLDG8V83 | 6,54 | – | – |
| Thesaurierende Klasse SEK I2 | 19.05.2021 | IE00BN92ZN54 | (2,00) | (20,89) | 11,51 |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 17.02.2015 | IE00B99K3R14 | (4,10) | (19,90) | 11,36 |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 31.10.2014 | IE00B986J720 | (4,04) | (19,53) | 13,08 |
| Thesaurierende Klasse USD A | 31.05.2013 | IE00B986J944 | (4,05) | (19,51) | 13,06 |
| Ausschüttende Klasse USD A | 30.10.2020 | IE00B986JM76 | (4,01) | (19,54) | 13,01 |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 24.08.2017 | IE00BDFBJ891 | (5,02) | (20,28) | 11,95 |
| Thesaurierende Klasse USD I | 31.05.2013 | IE00B99K4563 | (3,32) | (18,98) | 13,87 |
| Ausschüttende Klasse USD I | 31.05.2013 | IE00B99K4670 | (3,34) | (18,95) | 13,87 |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 15.11.2016 | IE00B99K6R29 | (3,23) | (18,80) | 13,97 |
| Ausschüttende Klasse USD I2 | 20.04.2018 | IE00B99K6W71 | (3,24) | (18,74) | 14,00 |
| Ausschüttende Klasse USD I3 | 20.03.2019 | IE00BCFFTG28 | (3,14) | (18,77) | 14,22 |
| Thesaurierende Klasse USD M | 25.08.2017 | IE00BDFBJ909 | (4,82) | (20,15) | 12,21 |
| Ausschüttende Klasse USD M | 15.09.2017 | IE00BDFBJB28 | (4,74) | (20,22) | 12,26 |
| Thesaurierende Klasse USD P | 11.01.2018 | IE00BTKH9G20 | (3,33) | (18,86) | 13,85 |
| Thesaurierende Klasse USD X | 16.12.2021 | IE000BX4CH70 | 0,30 | (18,74) | 14,11 |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 26.04.2017 | IE00BD4H0C99 | (2,70) | (18,34) | 14,67 |

Emerging Market Debt - Local Currency

| | | | | | |
|---|------------|--------------|---------|---------|-------|
| Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) | 04.06.2015 | IE00BTLWS819 | (11,82) | (15,78) | 9,48 |
| Thesaurierende Klasse AUD B | 04.06.2015 | IE00BTLWS702 | (11,87) | (15,89) | 9,45 |
| Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich) | 04.06.2015 | IE00BTLWSB42 | (12,16) | (15,84) | – |
| Thesaurierende Klasse AUD C2 | 04.06.2015 | IE00BTLWS926 | (11,96) | (15,91) | 9,59 |
| Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) | 04.06.2015 | IE00BTLWSD65 | (11,78) | (15,97) | 9,79 |
| Thesaurierende Klasse AUD E | 04.06.2015 | IE00BTLWSC58 | (11,88) | (15,91) | 9,46 |
| Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) | 04.06.2015 | IE00BTLWSG96 | (10,95) | (15,20) | 10,70 |
| Thesaurierende Klasse AUD T | 04.06.2015 | IE00BTLWSF89 | (10,97) | (15,01) | 10,48 |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 28.06.2013 | IE00B975F382 | (11,12) | (15,87) | 10,28 |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 28.06.2013 | IE00B975F507 | (10,42) | (15,27) | 11,02 |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | 27.06.2017 | IE00BD5BKf38 | (2,55) | (7,15) | 10,09 |

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum 31. Dezember

| Anteilklasse | Auflegungsdatum | ISIN | Geschäftsjahr zum 31. Dezember | | |
|--|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
| | | | 2021 % | 2022 % | 2023 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert) | 29.12.2015 | IE00BZ1J8T56 | (2,42) | (7,10) | 10,22 |
| Ausschüttende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert) | 12.03.2019 | IE00BJ2JSW56 | (2,33) | – | – |
| Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) | 14.03.2017 | IE00BYX7M324 | (2,29) | (6,87) | 10,41 |
| Ausschüttende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | 18.02.2016 | IE00BD9WJ885 | (3,99) | – | – |
| Thesaurierende Klasse EUR Y (nicht währungsgesichert) | 25.01.2021 | IE00BMY4BL92 | (1,10) | (6,77) | 10,41 |
| Thesaurierende Klasse GBP I | 22.09.2017 | IE00BDZRNT61 | (9,84) | (13,95) | 12,81 |
| Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) | 02.11.2016 | IE00BYX4Q207 | (8,30) | (1,63) | 7,76 |
| Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) | 02.11.2016 | IE00BYSW3D96 | (8,32) | (1,63) | 7,94 |
| Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert) | 25.01.2021 | IE00BMY4BM00 | (6,40) | (1,50) | 7,92 |
| Thesaurierende Klasse SEK A | 05.11.2015 | IE00BYSW3401 | (10,94) | (15,78) | 10,22 |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 04.03.2015 | IE00B99K6K59 | (10,26) | (14,02) | 11,31 |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 31.10.2014 | IE00B99K7G88 | (10,19) | (13,38) | 12,99 |
| Thesaurierende Klasse USD A | 28.06.2013 | IE00B99K7H95 | (10,19) | (13,46) | 12,98 |
| Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) | 04.06.2015 | IE00BTLWSH04 | (11,35) | (14,56) | 11,71 |
| Thesaurierende Klasse USD B | 04.06.2015 | IE00B99K7M49 | (11,28) | (14,64) | 11,51 |
| Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich) | 04.06.2015 | IE00BTLWSJ28 | (11,35) | (14,56) | 11,71 |
| Thesaurierende Klasse USD C2 | 04.06.2015 | IE00B99K7Z77 | (11,36) | (14,64) | – |
| Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) | 04.06.2015 | IE00BTLWSL40 | (11,35) | (14,56) | 11,71 |
| Thesaurierende Klasse USD E | 04.06.2015 | IE00BTLWSK33 | (11,28) | (14,64) | 11,64 |
| Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) | 02.09.2021 | IE00080NF9F1 | (6,22) | (12,87) | 13,97 |
| Thesaurierende Klasse USD I | 28.06.2013 | IE00B9Z1CL57 | (9,35) | (12,92) | 13,88 |
| Ausschüttende Klasse USD I | 14.10.2016 | IE00BYT43784 | (9,46) | (12,85) | 13,94 |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 13.08.2014 | IE00B9Z1CN71 | (9,27) | (12,69) | 14,04 |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 26.09.2018 | IE00BYNVFZ74 | (9,97) | (15,46) | 12,33 |
| Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) | 31.03.2016 | IE00BTLWSM56 | (10,34) | (13,76) | 12,86 |
| Thesaurierende Klasse USD T | 04.06.2015 | IE00B9Z1CQ03 | (10,40) | (13,81) | 12,78 |
| Thesaurierende Klasse USD X | 23.10.2013 | IE00B9Z1CS27 | (9,05) | (12,49) | 14,39 |
| Thesaurierende Klasse USD Y | 14.01.2021 | IE00BMY4BK85 | (8,20) | (12,53) | 14,32 |
| Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich) | 05.06.2015 | IE00BTLWSP87 | (8,00) | (12,08) | 14,22 |
| Thesaurierende Klasse ZAR B | 05.06.2015 | IE00BTLWSN63 | (8,01) | (12,11) | 14,18 |
| Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich) | 05.06.2015 | IE00BTLWSR02 | (8,01) | (12,07) | 14,29 |
| Thesaurierende Klasse ZAR C2 | 06.01.2023 | IE00BTLWSQ94 | (8,01) | (12,10) | 12,75 |
| Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) | 05.06.2015 | IE00BTLWSS19 | (8,02) | (12,07) | 14,22 |
| Thesaurierende Klasse ZAR E | 05.06.2015 | IE00BTLWST26 | (8,02) | (12,10) | 14,12 |
| Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) | 05.06.2015 | IE00BTLWSW54 | (7,07) | (11,19) | 15,36 |
| Thesaurierende Klasse ZAR T | 05.06.2015 | IE00BTLWSV48 | (7,07) | (11,23) | 15,33 |
| Emerging Market Debt Blend | | | | | |
| Ausschüttende Klasse AUD I3 | 06.11.2019 | IE00BKPHZ39 | (2,90) | (11,15) | 11,37 |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 04.12.2015 | IE00BK4YZ020 | (3,48) | (12,89) | 8,28 |

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

| Anteilklasse | Auflegungsdatum | ISIN | Geschäftsjahr zum 31. Dezember | | |
|--|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
| | | | 2021 % | 2022 % | 2023 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 08.07.2014 | IE00BK4YYZ03 | (2,75) | (12,29) | 8,97 |
| Ausschüttende Klasse EUR I | 19.06.2015 | IE00BY7S2G49 | (2,70) | (12,26) | 8,97 |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 27.05.2014 | IE00BMMV6Y07 | (2,60) | (12,16) | 9,13 |
| Ausschüttende Klasse EUR I2 | 24.02.2015 | IE00BMMV6Z14 | (2,62) | (12,21) | 9,24 |
| Ausschüttende Klasse EUR I3 | 05.11.2019 | IE00BLDYHM63 | (2,56) | (12,11) | 9,37 |
| Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) | 23.03.2017 | IE00BD3WDH16 | 1,71 | (8,23) | 8,77 |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 23.04.2014 | IE00BLDYHL56 | (2,47) | (11,95) | 9,39 |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 29.01.2016 | IE00BSNLZD35 | (4,26) | (13,62) | 7,51 |
| Ausschüttende Klasse EUR M | 29.01.2016 | IE00BSNLZF58 | (4,28) | (13,51) | 7,29 |
| Thesaurierende Klasse EUR Z | 02.06.2014 | IE00BKKN1384 | (2,11) | (11,69) | 9,86 |
| Thesaurierende Klasse GBP I | 31.03.2016 | IE00BK4YYR29 | (5,56) | (9,05) | 8,64 |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | 12.04.2017 | IE00BD3WDG09 | (4,91) | (3,22) | 6,04 |
| Ausschüttende Klasse GBP I | 22.05.2018 | IE00BK4YYW71 | (5,52) | (9,08) | 8,63 |
| Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | 22.05.2018 | IE00BF0V1488 | (5,00) | (3,16) | 5,83 |
| Thesaurierende Klasse GBP P | 13.05.2019 | IE00BGPZW838 | (5,44) | (9,06) | 8,68 |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | 13.05.2019 | IE00BGPZW721 | (4,95) | (3,24) | 5,99 |
| Thesaurierende Klasse GBP Z | 17.03.2016 | IE00BKKN1509 | (4,83) | (8,41) | 9,36 |
| Thesaurierende Klasse NOK U | 13.03.2017 | IE00BZCPRQ22 | (5,03) | (9,72) | 12,67 |
| Thesaurierende Klasse SEK A | 05.11.2015 | IE00BMN92P65 | (2,08) | (9,24) | 8,57 |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 15.09.2017 | IE00BMN93084 | (5,70) | (15,04) | 9,75 |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 15.09.2017 | IE00BRJTF125 | (6,53) | (14,64) | 11,56 |
| Thesaurierende Klasse USD A | 04.02.2016 | IE00BK4YYX88 | (6,47) | (14,65) | 11,44 |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 24.08.2017 | IE00BDFBKG46 | (7,41) | (15,50) | 10,33 |
| Thesaurierende Klasse USD I | 23.04.2014 | IE00BK4YYS36 | (5,83) | (14,12) | 12,28 |
| Ausschüttende Klasse USD I | 01.06.2016 | IE00BK4YYT43 | (5,85) | (13,98) | 12,23 |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 24.09.2014 | IE00BMN93423 | (5,65) | – | – |
| Ausschüttende Klasse USD I2 | 24.02.2015 | IE00BMN93530 | (5,73) | (13,96) | 12,49 |
| Thesaurierende Klasse USD I3 | 20.12.2017 | IE00BD21NN56 | (5,61) | (13,90) | – |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 24.07.2023 | IE00BYSW4H00 | – | – | 4,00 |
| Thesaurierende Klasse USD M | 25.08.2017 | IE00BF46ZC54 | (7,20) | (15,32) | 10,49 |
| Ausschüttende Klasse USD M | 26.09.2017 | IE00BDFBKH52 | (7,18) | (15,37) | 10,60 |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 28.09.2015 | IE00BKKN1616 | (5,19) | (13,46) | 13,08 |

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

| | | | | | |
|------------------------------|------------|--------------|--------|---------|------|
| Thesaurierende Klasse AUD I2 | 16.02.2021 | IE00BM909D01 | (0,70) | (12,69) | 7,15 |
| Thesaurierende Klasse NOK I | 09.05.2018 | IE00BYT26W83 | (4,07) | (11,43) | 8,34 |
| Thesaurierende Klasse NOK I3 | 05.09.2023 | IE00BYT26Z15 | – | – | 3,13 |
| Thesaurierende Klasse USD I | 10.07.2017 | IE00BD3DV032 | (4,96) | (14,33) | 8,32 |

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum 31. Dezember

| Anteilklasse | Auflegungsdatum | ISIN | Geschäftsjahr zum 31. Dezember | | |
|------------------------------|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
| | | | 2021 % | 2022 % | 2023 % |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 16.03.2021 | IE00BMXC7C74 | 0,40 | (14,24) | 8,48 |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 02.11.2017 | IE00BD3DV362 | (4,39) | (13,84) | 9,00 |

Emerging Markets Equity

| | | | | | |
|--|------------|--------------|--------|---------|------|
| Thesaurierende Klasse AUD B | 30.11.2016 | IE00BYN4NY18 | (7,37) | (27,37) | 3,18 |
| Thesaurierende Klasse AUD C2 | 30.11.2016 | IE00BYN4NZ25 | (7,44) | (27,37) | 3,29 |
| Thesaurierende Klasse AUD E | 30.11.2016 | IE00BYN4P011 | (7,44) | (27,39) | 3,18 |
| Thesaurierende Klasse AUD T | 30.11.2016 | IE00BYN4P128 | (6,44) | (26,70) | 4,33 |
| Ausschüttende Klasse CAD I (nicht währungsgesichert) | 24.01.2018 | IE00BF8P8L84 | (5,42) | (18,34) | 4,89 |
| Ausschüttende Klasse CAD I2 | 17.12.2021 | IE000TTJ7N81 | 1,60 | (24,79) | 6,93 |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 04.10.2010 | IE00B3SRML86 | (5,58) | (26,37) | 5,12 |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 18.02.2016 | IE00BWB99R92 | (7,51) | (27,80) | 3,04 |
| Thesaurierende Klasse EUR Z | 05.02.2018 | IE00BKJ9SM50 | (4,65) | (25,58) | 6,14 |
| Thesaurierende Klasse GBP I | 15.01.2014 | IE00B3SC5588 | (5,09) | (25,19) | 6,76 |
| Thesaurierende Klasse GBP Z | 17.03.2016 | IE00BKJ9SX65 | (4,14) | (24,48) | 7,94 |
| Thesaurierende Klasse JPY I | 04.10.2010 | IE00B6780209 | 6,37 | – | – |
| Thesaurierende Klasse USD A | 04.10.2010 | IE00B3M56506 | (5,58) | (24,66) | 6,78 |
| Thesaurierende Klasse USD B | 30.11.2016 | IE00BYN4P235 | (6,52) | (25,34) | 5,62 |
| Thesaurierende Klasse USD C2 | 30.11.2016 | IE00BYN4P342 | (6,59) | (25,36) | 5,53 |
| Thesaurierende Klasse USD E | 30.11.2016 | IE00BYN4P458 | (6,59) | (25,43) | 5,63 |
| Thesaurierende Klasse USD I | 04.10.2010 | IE00B3NBSZ12 | (4,63) | (23,86) | 7,69 |
| Thesaurierende Klasse USD M | 27.05.2016 | IE00BYQQ4J61 | (6,51) | (25,40) | 5,66 |
| Thesaurierende Klasse USD T | 30.11.2016 | IE00BYN4P565 | (5,58) | (24,72) | 6,81 |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 30.06.2014 | IE00BKJ9TD35 | (3,66) | (23,12) | 8,87 |
| Thesaurierende Klasse ZAR B | 30.11.2016 | IE00BYN4P672 | (3,05) | (23,78) | 7,83 |
| Thesaurierende Klasse ZAR C2 | 30.11.2016 | IE00BYN4P789 | (3,05) | (23,79) | 7,82 |
| Thesaurierende Klasse ZAR E | 30.11.2016 | IE00BYN4P896 | (3,05) | (23,78) | 7,83 |
| Thesaurierende Klasse ZAR T | 30.11.2016 | IE00BYN4P904 | (2,08) | (23,02) | 8,92 |

Emerging Markets Select Equity*

| | | | | | |
|---|------------|--------------|--------|---------|---|
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | 08.01.2020 | IE00BKLC3T45 | 3,13 | (20,04) | – |
| Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert) | 03.12.2018 | IE00BG365X48 | 6,94 | (14,04) | – |
| Thesaurierende Klasse USD I | 24.10.2017 | IE00BZ3CFW46 | (4,07) | (25,02) | – |
| Ausschüttende Klasse USD I | 24.10.2017 | IE00BZ3CFV39 | (4,13) | – | – |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 22.11.2017 | IE00BZ3CFZ76 | (3,74) | (24,71) | – |

* Das Portfolio wurde am 7. September 2023 aufgelöst.

Euro Bond

| | | | | | |
|-----------------------------|------------|--------------|------|---------|------|
| Thesaurierende Klasse EUR I | 13.11.2018 | IE00BD9GYJ62 | 0,94 | (15,59) | 9,94 |
|-----------------------------|------------|--------------|------|---------|------|

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

| Euro Bond (Fortsetzung) | | | Geschäftsjahr zum 31. Dezember | | |
|---|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
| Anteilklasse | Auflegungsdatum | ISIN | 2021 % | 2022 % | 2023 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I | 14.11.2018 | IE00BFZMGH42 | 0,94 | (15,68) | 9,96 |
| Euro Bond Absolute Return | | | | | |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 29.11.2018 | IE00BFZMG962 | 3,27 | (4,71) | 8,17 |
| Ausschüttende Klasse EUR I | 29.11.2018 | IE00BFZMGB89 | 3,19 | (4,58) | 8,10 |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 28.03.2019 | IE00BGL9FP72 | 3,47 | (4,44) | 8,34 |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 22.11.2019 | IE00BHXMF734 | 4,61 | (2,25) | 10,87 |
| European High Yield Bond | | | | | |
| Thesaurierende Klasse CHF I | 14.03.2023 | IE00BNH72864 | – | – | 7,50 |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 27.06.2014 | IE00BNH72V92 | 3,88 | (9,53) | 13,53 |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 08.11.2023 | IE00BNH72Y24 | – | – | 5,40 |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 22.11.2023 | IE00U0XGY04 | – | – | 4,40 |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 29.01.2016 | IE00BSNLZ880 | 2,60 | (10,59) | 12,11 |
| Thesaurierende Klasse EUR X | 20.02.2018 | IE00BD2B9W69 | 4,20 | (9,15) | 13,96 |
| Thesaurierende Klasse EUR Y | 04.01.2023 | IE00TAL07E4 | – | – | 13,00 |
| Ausschüttende Klasse EUR Y | 27.06.2023 | IE000MDTVTW7 | – | – | 8,72 |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 09.05.2019 | IE00BNH73D85 | 3,98 | – | – |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 31.10.2014 | IE00BNH73J48 | 4,06 | (8,12) | 15,17 |
| Thesaurierende Klasse USD I | 27.06.2014 | IE00BNH73L69 | 4,69 | (7,54) | 15,88 |
| Thesaurierende Klasse USD X | 12.01.2018 | IE00BD2B9Y83 | 5,06 | (7,15) | 16,32 |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 26.04.2019 | IE00BPT29L50 | 5,31 | (6,95) | 16,53 |
| European Sustainable Equity | | | | | |
| Ausschüttende Klasse EUR A | 12.01.2022 | IE000YS2J411 | – | (20,70) | 17,78 |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 24.02.2021 | IE00BMQC7246 | 21,40 | (24,96) | 18,99 |
| Ausschüttende Klasse EUR I | 24.02.2021 | IE00BMQC7B38 | 21,50 | (25,02) | 19,00 |
| Ausschüttende Klasse EUR I3 | 07.10.2021 | IE000S1PE6L2 | 3,70 | (24,86) | 19,19 |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 20.07.2021 | IE00BM9TKM36 | 5,70 | (24,69) | 19,22 |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 24.02.2021 | IE00BMG4Q673 | 19,70 | (26,23) | 16,99 |
| Thesaurierende Klasse EUR Z | 29.03.2021 | IE00BKP80429 | 20,90 | (24,57) | 19,74 |
| Thesaurierende Klasse USD A (nicht währungsgesichert) | 15.03.2021 | IE00BKPKM643 | 15,00 | (30,17) | 22,04 |
| Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) | 15.03.2021 | IE00BNC01617 | 15,80 | (29,62) | 23,19 |
| Thesaurierende Klasse USD M (nicht währungsgesichert) | 15.03.2021 | IE00BKPKM536 | 14,30 | (30,80) | 21,11 |
| Event Driven² | | | | | |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 17.01.2023 | IE000GM3WKE5 | – | – | 3,10 |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 | 26.10.2022 | IE0004B8PGL9 | – | 1,10 | 4,25 |
| Ausschüttende Klasse GBP I5 | 26.10.2022 | IE000TEWJNL5 | – | 1,10 | 4,35 |
| Thesaurierende Klasse GBP P | 26.10.2022 | IE000TQXBRW2 | – | 1,00 | 3,96 |

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

Event Driven² (Fortsetzung)

| Anteilklasse | Auflegungsdatum | ISIN | Geschäftsjahr zum 31. Dezember | | |
|------------------------------|-----------------|--------------|--------------------------------|------|------|
| | | | 2021 | 2022 | 2023 |
| | | | % | % | % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 26.10.2022 | IE000F96D003 | – | 1,20 | 4,25 |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 26.10.2022 | IE00033HFZ64 | – | 1,30 | 4,74 |

Global Bond

| | | | | | |
|---|------------|--------------|--------|---------|------|
| Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) | 03.02.2021 | IE00BMH55D96 | (5,90) | (17,25) | 4,22 |
| Thesaurierende Klasse EUR I Benchmark Währungsgesicherte Klasse | 31.08.2023 | IE000F6CED02 | – | – | 4,00 |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 03.01.2018 | IE00B8H49690 | (6,20) | (16,72) | 5,25 |
| Thesaurierende Klasse USD I Benchmark Währungsgesicherte Klasse | 26.09.2022 | IE000028YR76 | – | 1,80 | 7,86 |
| Thesaurierende Klasse USD I | 16.07.2012 | IE00B8GFHY73 | (4,83) | (15,67) | 6,54 |
| Thesaurierende Klasse USD M | 02.07.2018 | IE00BDFBKC08 | (5,86) | (16,36) | 6,00 |
| Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) | 03.02.2021 | IE00BMH55G28 | (4,27) | (16,15) | 6,03 |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 20.01.2017 | IE00BKJ9T774 | (4,48) | (15,41) | 6,83 |
| Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) | 03.02.2021 | IE00BMH55J58 | (1,69) | (13,12) | 8,79 |

Global Diversified Income FMP – 2024

| | | | | | |
|-----------------------------|------------|--------------|--------|--------|------|
| Thesaurierende Klasse EUR A | 07.07.2020 | IE00BL1NN727 | (1,24) | (6,39) | 3,31 |
| Ausschüttende Klasse EUR A | 10.07.2020 | IE00BL1NN834 | (1,25) | (6,28) | 3,20 |
| Ausschüttende Klasse EUR I | 29.07.2020 | IE00BL1NNB65 | (0,72) | (6,00) | 3,72 |
| Ausschüttende Klasse GBP I | 22.06.2020 | IE00BK5C7S77 | (0,06) | (4,41) | 5,42 |
| Ausschüttende Klasse HKD A | 28.07.2020 | IE00BL1NN271 | (0,46) | (4,88) | 4,48 |
| Ausschüttende Klasse SGD A | 22.06.2020 | IE00BL1NNG11 | (0,35) | (4,56) | 4,11 |
| Thesaurierende Klasse USD A | 22.06.2020 | IE00BL1NMV96 | (0,38) | (4,39) | 5,49 |
| Ausschüttende Klasse USD A | 22.06.2020 | IE00BL1NMW04 | (0,41) | (4,28) | 5,35 |
| Thesaurierende Klasse USD I | 22.06.2020 | IE00BL1NMX11 | – | (3,99) | 5,84 |
| Ausschüttende Klasse USD I | 22.06.2020 | IE00BL1NMY28 | 0,01 | (3,99) | 5,89 |
| Thesaurierende Klasse USD X | 22.06.2020 | IE00BL1NMZ35 | – | (4,08) | 5,84 |
| Ausschüttende Klasse USD X | 22.06.2020 | IE00BL1NN057 | (0,06) | (3,94) | 5,72 |

Global Equity Megatrends

| | | | | | |
|---|------------|--------------|-------|---------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR I | 22.12.2023 | IE00BKPHW986 | – | – | (0,50) |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | 19.10.2018 | IE00BFZ89Z14 | 24,90 | (9,70) | 16,89 |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | 05.07.2023 | IE000MDM6X16 | – | – | 6,30 |
| Thesaurierende Klasse SGD A | 08.12.2023 | IE000HM1TOC0 | – | – | 4,25 |
| Thesaurierende Klasse USD A | 27.04.2018 | IE00BFMHRM44 | 17,07 | (14,51) | 21,88 |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 27.04.2018 | IE00BFMHRM06 | 15,95 | (15,40) | 20,72 |
| Thesaurierende Klasse USD I | 27.04.2018 | IE00BFMHRK20 | 18,26 | (13,78) | 22,91 |
| Thesaurierende Klasse USD M | 27.04.2018 | IE00BFMHRM13 | 16,03 | (15,24) | 20,92 |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 25.02.2022 | IE00BFMHRN50 | – | (12,30) | 23,95 |

Global Flexible Credit Income

| | | | | | |
|------------------------------|------------|--------------|------|---------|-------|
| Thesaurierende Klasse CAD I5 | 18.03.2021 | IE00BMDQ4176 | 3,90 | (10,11) | 12,10 |
|------------------------------|------------|--------------|------|---------|-------|

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

Global Flexible Credit Income (Fortsetzung)

| Anteilklasse | Auflegungsdatum | ISIN | Geschäftsjahr zum 31. Dezember | | |
|------------------------------|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
| | | | 2021 % | 2022 % | 2023 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 29.09.2020 | IE00BKPV7063 | 2,23 | (11,99) | 10,01 |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 13.08.2020 | IE00BKPV6Z45 | 0,85 | (13,31) | 8,65 |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 | 01.06.2020 | IE00BMD7Z951 | 3,27 | (10,34) | 12,11 |
| Thesaurierende Klasse USD A | 16.09.2020 | IE00BKPV6V07 | 2,54 | (10,48) | 11,81 |
| Thesaurierende Klasse USD I | 01.06.2020 | IE00BMD7Z621 | 3,17 | (9,91) | 12,52 |
| Ausschüttende Klasse USD I | 01.06.2020 | IE00BMD7Z738 | 3,10 | (9,89) | 12,43 |
| Thesaurierende Klasse USD M | 16.09.2020 | IE00BKPV6Y38 | 1,61 | (11,15) | 10,88 |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 01.06.2020 | IE00BMD7Z845 | 3,78 | (9,40) | 13,18 |

Global High Yield SDG Engagement

| | | | | | |
|----------------------------------|------------|--------------|------|---------|-------|
| Ausschüttende Klasse AUD I | 03.05.2022 | IE00BLRPMZ33 | – | (5,65) | 8,54 |
| Thesaurierende Klasse CHF I4 | 03.05.2022 | IE000NWK9054 | – | (4,70) | 6,09 |
| Ausschüttende Klasse CHF I4 | 03.05.2022 | IE000FKA7HA8 | – | (4,70) | 6,10 |
| Thesaurierende Klasse CHF X | 03.05.2022 | IE000UJH5394 | – | (5,10) | 5,37 |
| Thesaurierende Klasse EUR I4 | 03.05.2022 | IE000FQ3GMZ6 | – | (4,90) | 8,20 |
| Ausschüttende Klasse EUR I4 | 03.05.2022 | IE000R3WKJZ3 | – | (4,87) | 8,10 |
| Thesaurierende Klasse EUR X | 03.05.2022 | IE000BDJ74G5 | – | (5,40) | 7,40 |
| Thesaurierende Klasse EUR Z (PF) | 04.08.2016 | IE00BD0PCC14 | 3,38 | (12,82) | 8,43 |
| Thesaurierende Klasse GBP I4 | 03.05.2022 | IE000HVII8Q5 | – | (3,70) | 9,97 |
| Thesaurierende Klasse GBP X | 03.05.2022 | IE0000OR7613 | – | (4,10) | 9,07 |
| Thesaurierende Klasse USD A | 16.08.2016 | IE00BZ090126 | 3,15 | (11,66) | 9,65 |
| Thesaurierende Klasse USD I | 04.08.2016 | IE00BYMW5M88 | 3,73 | (11,16) | 10,29 |
| Thesaurierende Klasse USD I4 | 03.05.2022 | IE0003AEEC94 | – | (3,00) | 10,62 |
| Ausschüttende Klasse USD M | 29.01.2018 | IE00BDFBKM06 | 2,50 | (12,19) | 8,93 |
| Thesaurierende Klasse USD X | 10.11.2020 | IE00BNC27034 | 4,26 | (11,43) | 9,76 |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 04.08.2016 | IE00BD0PC768 | 4,39 | (10,66) | 11,04 |

Global High Yield Sustainable Action*

| | | | | | |
|-----------------------------|------------|--------------|------|---------|---|
| Thesaurierende Klasse USD I | 21.01.2020 | IE00BL3NDN61 | 2,81 | (11,49) | – |
| Ausschüttende Klasse USD I | 21.01.2020 | IE00BL3NDP85 | 2,74 | (11,52) | – |
| Thesaurierende Klasse USD X | 10.11.2020 | IE00BNC27141 | 3,16 | (11,20) | – |
| Thesaurierende Klasse USD Y | 25.02.2021 | IE00BMDQ4283 | 2,80 | (11,19) | – |

* Das Portfolio wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

Global Investment Grade Credit

| | | | | | |
|-----------------------------|------------|--------------|--------|---------|------|
| Thesaurierende Klasse EUR I | 27.07.2023 | IE000CEVL7G2 | – | – | 5,10 |
| Thesaurierende Klasse USD I | 01.09.2021 | IE00BN6JC279 | (1,20) | (14,57) | 9,60 |
| Thesaurierende Klasse USD X | 01.09.2021 | IE00BN6JC386 | (1,20) | (14,37) | 9,81 |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 01.09.2021 | IE00BN6JC493 | (1,10) | (14,36) | 9,92 |

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

Global Opportunistic Bond

Geschäftsjahr zum 31. Dezember

| Anteilklasse | Auflegungsdatum | ISIN | Geschäftsjahr zum 31. Dezember | | |
|------------------------------|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
| | | | 2021 % | 2022 % | 2023 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 27.11.2020 | IE00BNDQ3Y07 | 0,10 | (13,49) | 11,01 |
| Thesaurierende Klasse GBP P | 16.01.2020 | IE00BJXCZR70 | 0,76 | (12,09) | 5,59 |
| Thesaurierende Klasse USD A | 22.09.2017 | IE00BD3WF316 | 0,43 | (11,82) | 5,97 |
| Thesaurierende Klasse USD I | 20.12.2016 | IE00BD3WD824 | 0,82 | (11,44) | 6,23 |
| Ausschüttende Klasse USD I | 20.12.2016 | IE00BD3WD931 | 0,81 | (11,52) | 6,30 |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 23.04.2018 | IE00BF0V1595 | 0,87 | (11,42) | 6,30 |
| Thesaurierende Klasse USD M | 18.12.2019 | IE00BF47NM48 | (0,09) | – | – |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 16.05.2019 | IE00BD3WDB53 | 1,25 | (11,23) | 6,57 |

Global Real Estate Securities

| | | | | | |
|---|------------|--------------|-------|---------|------|
| Ausschüttende Klasse EUR I5 | 08.07.2021 | IE00068K7LS0 | 9,00 | (27,80) | – |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 29.01.2016 | IE00BYNBZJ17 | 24,20 | (29,30) | 3,04 |
| Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert) | 04.11.2020 | IE00BLP47350 | 38,35 | (20,04) | 4,80 |
| Thesaurierende Klasse GBP Z | 17.03.2016 | IE00BSPPW214 | 27,93 | (26,55) | 7,39 |
| Thesaurierende Klasse USD A | 09.05.2019 | IE00BSPPW651 | 26,67 | (26,09) | 6,92 |
| Thesaurierende Klasse USD CI | 08.01.2020 | IE00BF47NP78 | 25,45 | (26,79) | 5,82 |
| Thesaurierende Klasse USD I | 30.12.2014 | IE00BSPPW875 | 27,63 | (25,56) | 7,65 |
| Ausschüttende Klasse USD I5 | 20.12.2019 | IE00BL4KJW74 | 28,03 | (25,27) | 8,14 |
| Thesaurierende Klasse USD M | 02.10.2019 | IE00BF47NQ85 | 25,54 | (26,85) | 5,78 |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 13.02.2015 | IE00BSPPWG54 | 28,64 | (24,96) | 8,43 |

Global Sustainable Equity

| | | | | | |
|--|------------|--------------|-------|---------|-------|
| Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) | 24.02.2021 | IE00BL5BFR67 | 31,80 | (23,37) | 19,90 |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | 24.02.2021 | IE00BMG4Q566 | 29,60 | (24,92) | 17,47 |
| Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert) | 31.03.2021 | IE00BKP80536 | 26,80 | (23,11) | 20,21 |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | 06.04.2021 | IE00BMG4Q459 | 22,00 | (19,26) | 16,65 |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert) | 06.04.2021 | IE00BN6JBK81 | 22,20 | (18,99) | 17,07 |
| Thesaurierende Klasse USD A | 02.12.2021 | IE00BKPKM429 | 2,40 | (28,91) | 22,53 |
| Thesaurierende Klasse USD I | 24.02.2021 | IE00BMQC6Y99 | 23,30 | (28,39) | 23,78 |
| Ausschüttende Klasse USD I | 24.02.2021 | IE00BMQC7139 | 23,30 | (28,30) | 23,76 |
| Thesaurierende Klasse USD M | 15.03.2021 | IE00BKPKM312 | 21,00 | (29,42) | 21,55 |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 25.02.2022 | IE000BASSUZ5 | – | (16,80) | 24,40 |

Global Sustainable Value

| | | | | | |
|--|------------|--------------|-------|---------|-------|
| Thesaurierende Klasse EUR M | 29.01.2016 | IE00BYNBZH92 | 17,25 | (16,84) | 12,41 |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert) | 27.09.2022 | IE0007DELM88 | – | 0,80 | 10,32 |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | 20.10.2023 | IE00BDB16154 | – | – | 7,00 |
| Thesaurierende Klasse USD A | 14.08.2017 | IE00BSNM7G36 | 19,42 | (13,31) | 16,17 |
| Thesaurierende Klasse USD I | 18.12.2014 | IE00BSNM7J66 | 20,01 | (12,92) | 16,70 |
| Thesaurierende Klasse USD I3 | 31.05.2022 | IE0006B0IPZ0 | – | (5,30) | 16,79 |

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

| Global Sustainable Value (Fortsetzung) | | | Geschäftsjahr zum 31. Dezember | | |
|--|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
| Anteilklasse | Auflegungsdatum | ISIN | 2021 % | 2022 % | 2023 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 24.05.2016 | IE00BSNM7Q34 | 20,71 | (12,53) | 17,25 |
| High Yield Bond | | | | | |
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | 05.09.2012 | IE00B7VR8263 | 3,57 | (13,52) | 8,87 |
| Thesaurierende Klasse AUD A | 28.08.2012 | IE00B5NTQ667 | 3,51 | (13,50) | 8,85 |
| Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) | 22.07.2013 | IE00B9276P83 | 1,72 | (14,90) | 7,27 |
| Thesaurierende Klasse AUD B | 10.12.2020 | IE00B8HXFL36 | 1,79 | (14,94) | 7,12 |
| Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich) | 19.07.2013 | IE00B9276Q90 | 1,73 | (14,87) | 7,27 |
| Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) | 02.07.2014 | IE00BNJZT320 | 1,92 | (14,86) | 7,06 |
| Thesaurierende Klasse AUD E | 02.07.2014 | IE00BNJZT213 | 1,85 | (14,90) | 7,13 |
| Ausschüttende Klasse AUD I | 29.12.2011 | IE00B52MT459 | 4,11 | (13,01) | 9,56 |
| Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) | 27.06.2013 | IE00B9276R08 | 2,93 | (14,09) | 8,27 |
| Ausschüttende Klasse AUD T (Wöchentlich) | 11.06.2013 | IE00B95QHL52 | 2,90 | (14,08) | 8,16 |
| Thesaurierende Klasse AUD T | 02.08.2013 | IE00B8HXFR97 | 2,84 | (13,96) | 8,20 |
| Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich) | 23.07.2013 | IE00B8HXG658 | 3,62 | (12,76) | 9,80 |
| Thesaurierende Klasse CHF A | 05.07.2011 | IE00B5YJD53 | 2,75 | (14,78) | 6,19 |
| Thesaurierende Klasse CHF I | 27.05.2011 | IE00B53JGK04 | 3,41 | (14,25) | 6,87 |
| Thesaurierende Klasse CHF I2 | 22.10.2013 | IE00BCDYX925 | 3,48 | (14,18) | 6,97 |
| Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) | 01.08.2012 | IE00B7YPR088 | 6,52 | (11,77) | 7,57 |
| Ausschüttende Klasse CNY I (Monatlich) | 09.11.2012 | IE00B841H259 | 7,15 | (11,23) | 8,22 |
| Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) | 19.06.2012 | IE00B4024J04 | 3,04 | (14,81) | 8,22 |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 03.05.2006 | IE00B12VWB25 | 2,95 | (14,76) | 8,25 |
| Ausschüttende Klasse EUR A | 24.02.2012 | IE00B718SL89 | 2,95 | (14,73) | 8,25 |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 09.11.2009 | IE00B12VW904 | 3,65 | (14,30) | 8,96 |
| Ausschüttende Klasse EUR I | 18.10.2012 | IE00B8FFFY43 | 3,64 | (14,32) | 9,01 |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 05.12.2012 | IE00B86LQM64 | 3,65 | (14,18) | 9,00 |
| Ausschüttende Klasse EUR I2 | 05.12.2012 | IE00B6TSG197 | 3,72 | (14,23) | 9,00 |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 09.01.2020 | IE00BKKL6930 | 3,98 | – | – |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 29.01.2016 | IE00BSS7G446 | 2,43 | (15,29) | 7,63 |
| Thesaurierende Klasse EUR Z | 05.11.2014 | IE00BKJ95L31 | 4,22 | (13,73) | 9,48 |
| Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich) | 07.07.2014 | IE00BCDYX818 | 3,60 | (13,21) | 10,12 |
| Thesaurierende Klasse GBP A | 27.04.2011 | IE00B1G9WD45 | 3,62 | (13,18) | 9,99 |
| Ausschüttende Klasse GBP A | 24.02.2012 | IE00B1G9WG75 | 3,66 | (13,27) | 9,98 |
| Thesaurierende Klasse GBP I | 27.07.2010 | IE00B1G9WC38 | 4,25 | (12,69) | 10,69 |
| Ausschüttende Klasse GBP I | 08.11.2006 | IE00B1G9WJ07 | 4,32 | (12,72) | 10,56 |
| Thesaurierende Klasse GBP I2 | 05.12.2012 | IE00B76HSR65 | 4,31 | (12,60) | 10,81 |
| Ausschüttende Klasse GBP I2 | 05.12.2012 | IE00B8KDTL88 | 4,24 | (12,59) | 10,66 |
| Thesaurierende Klasse GBP Z | 17.03.2016 | IE00BKJ95N54 | 4,89 | (12,10) | 11,28 |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) | 14.09.2012 | IE00B87ZP976 | 3,85 | (12,84) | 9,62 |
| Thesaurierende Klasse SEK A | 16.06.2011 | IE00B5NOGF80 | 3,36 | (14,24) | 8,31 |

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum 31. Dezember

| Anteilklasse | Auflegungsdatum | ISIN | Geschäftsjahr zum 31. Dezember | | |
|--|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
| | | | 2021 % | 2022 % | 2023 % |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 30.03.2012 | IE00B513D147 | 3,82 | (12,73) | 9,09 |
| Thesaurierende Klasse SGD A | 09.03.2012 | IE00B3VJ3Q31 | 3,82 | (12,74) | 9,14 |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 02.05.2012 | IE00B4KRFX62 | 3,84 | (12,45) | 10,74 |
| Ausschüttende Klasse USD A (Wöchentlich) | 22.01.2013 | IE00B88XV589 | 3,85 | (12,35) | 10,65 |
| Thesaurierende Klasse USD A | 11.01.2010 | IE00B12VW672 | 3,85 | (12,40) | 10,72 |
| Ausschüttende Klasse USD A | 24.02.2012 | IE00B1G9WM36 | 3,90 | (12,37) | 10,72 |
| Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) | 31.10.2012 | IE00B9276S15 | 2,23 | (13,86) | 9,04 |
| Thesaurierende Klasse USD B | 31.10.2012 | IE00B9276M52 | 2,19 | (13,72) | 8,92 |
| Thesaurierende Klasse USD C | 21.11.2012 | IE00B8JXNK68 | 3,20 | (12,91) | 10,02 |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 25.10.2017 | IE00B8521692 | 2,90 | (13,29) | 9,64 |
| Ausschüttende Klasse USD C1 | 07.09.2017 | IE00BF2DC164 | 2,76 | (13,20) | 9,55 |
| Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich) | 31.10.2012 | IE00B9276T22 | 2,23 | (13,86) | 8,84 |
| Thesaurierende Klasse USD C2 | 31.10.2012 | IE00B9276N69 | 2,27 | (13,78) | 8,91 |
| Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) | 02.07.2014 | IE00BLDYHX78 | 2,15 | (13,73) | 9,02 |
| Thesaurierende Klasse USD E | 02.07.2014 | IE00BNJZWJ94 | 2,25 | (13,80) | 8,97 |
| Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) | 13.09.2012 | IE00B6VF0729 | 4,39 | (11,86) | 11,37 |
| Thesaurierende Klasse USD I | 03.05.2006 | IE00B12VW565 | 4,51 | (11,84) | 11,36 |
| Ausschüttende Klasse USD I | 16.11.2006 | IE00B1G9WK12 | 4,57 | (11,90) | 11,36 |
| Ausschüttende Klasse USD I2 (Monatlich) | 24.09.2015 | IE00BH2RDM00 | 4,69 | (11,82) | 11,49 |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 05.12.2012 | IE00B8QBIF01 | 4,64 | (11,74) | 11,46 |
| Ausschüttende Klasse USD I2 | 05.12.2012 | IE00B8BBXZ30 | 4,61 | (11,79) | 11,55 |
| Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich) | 01.06.2016 | IE00BYX24752 | 4,75 | (11,71) | 11,63 |
| Thesaurierende Klasse USD M | 18.02.2016 | IE00BD9WHR30 | 3,26 | (12,93) | 10,07 |
| Ausschüttende Klasse USD M | 01.03.2018 | IE00BDFBKN13 | 3,24 | (12,84) | 10,05 |
| Thesaurierende Klasse USD P | 09.01.2018 | IE00BTKH9V70 | 4,49 | (11,82) | 11,43 |
| Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) | 31.10.2012 | IE00B9276V44 | 3,31 | (12,92) | 9,99 |
| Ausschüttende Klasse USD T (Wöchentlich) | 11.06.2013 | IE00B8B5Y742 | 3,17 | (12,83) | 9,91 |
| Thesaurierende Klasse USD T | 31.10.2012 | IE00B9276L46 | 3,22 | (12,90) | 10,07 |
| Ausschüttende Klasse USD U (Monatlich) | 02.05.2013 | IE00B7Y5Q239 | 4,28 | (12,17) | 10,97 |
| Thesaurierende Klasse USD U | 09.10.2012 | IE00B84LT637 | 4,22 | (12,16) | 11,04 |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 02.05.2014 | IE00BKJ9LT35 | 5,08 | (11,29) | 12,02 |
| Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich) | 11.06.2013 | IE00BBGB0S16 | 6,98 | (10,73) | 11,90 |
| Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich) | 11.06.2013 | IE00BBGB0T23 | 6,98 | (10,72) | 11,90 |
| Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) | 02.07.2014 | IE00BLDYHZ92 | 6,98 | (10,73) | 11,90 |
| Thesaurierende Klasse ZAR E | 02.07.2014 | IE00BNJZT544 | 6,99 | (10,73) | 11,90 |
| Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) | 11.06.2013 | IE00BBGB0V45 | 8,05 | (9,83) | 13,02 |
| Thesaurierende Klasse ZAR T | 19.12.2016 | IE00BCDYXM56 | 8,06 | (9,83) | 13,03 |
| InnovAsia 5G | | | | | |
| Thesaurierende Klasse CHF I4 | 14.07.2021 | IE000R62XXS0 | 8,60 | (41,16) | 26,76 |

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

InnovAsia 5G (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum 31. Dezember

| Anteilklasse | Auflegungsdatum | ISIN | Geschäftsjahr zum 31. Dezember | | |
|---|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
| | | | 2021 % | 2022 % | 2023 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 14.07.2021 | IE00051SPWY7 | 8,20 | (41,59) | 27,69 |
| Thesaurierende Klasse EUR I4 | 14.07.2021 | IE0001S98TH9 | 8,80 | (40,99) | 29,28 |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | 18.10.2021 | IE0005LXGGN3 | 19,40 | (36,52) | 25,33 |
| Thesaurierende Klasse EUR X | 14.07.2021 | IE000GVZECQ2 | 8,30 | (41,55) | 28,12 |
| Thesaurierende Klasse SGD A | 14.07.2021 | IE0004VBKI06 | 8,75 | (40,37) | 28,60 |
| Thesaurierende Klasse SGD I4 | 14.07.2021 | IE000FO9NFS0 | 9,40 | (39,67) | 30,15 |
| Thesaurierende Klasse SGD X | 14.07.2021 | IE0004JUGJ61 | 8,90 | (40,22) | 28,88 |
| Thesaurierende Klasse USD A | 14.07.2021 | IE00049QBO88 | 9,00 | (39,91) | 30,84 |
| Thesaurierende Klasse USD I | 14.07.2021 | IE000J2D2XC9 | 9,50 | (39,36) | 31,93 |
| Thesaurierende Klasse USD I4 | 14.07.2021 | IE0002MSVLE6 | 9,70 | (39,20) | 32,38 |
| Thesaurierende Klasse USD M | 05.11.2021 | IE0005QTSW89 | 5,10 | (40,44) | 29,87 |
| Thesaurierende Klasse USD X | 14.07.2021 | IE0007HVSXHO | 9,20 | (39,74) | 31,16 |

Japan Equity Engagement

| | | | | | |
|--|------------|--------------|--------|---------|-------|
| Ausschüttende Klasse EUR I5 | 10.02.2022 | IE0000I94UW8 | – | (5,40) | 28,28 |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 | 22.09.2021 | IE0000R9P9C5 | (6,60) | (12,96) | 26,94 |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert) | 06.07.2023 | IE000GH63MB3 | – | – | 7,80 |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | 11.11.2021 | IE0002CL69U2 | (6,10) | (15,97) | 6,34 |
| Thesaurierende Klasse JPY I | 12.05.2020 | IE00BLLXGR37 | 13,83 | (14,18) | 20,17 |
| Ausschüttende Klasse JPY I | 12.05.2020 | IE00BLLXGS44 | 13,83 | (14,18) | 20,17 |
| Thesaurierende Klasse JPY I5 | 16.02.2021 | IE00BL5B4J15 | 8,84 | (13,81) | 20,68 |
| Thesaurierende Klasse JPY Z | 28.04.2021 | IE00BMDOC484 | 6,57 | (13,44) | 21,19 |

Macro Opportunities FX

| | | | | | |
|-----------------------------|------------|--------------|--------|--------|------|
| Thesaurierende Klasse EUR I | 04.12.2019 | IE00BK70Z635 | (2,37) | (2,53) | 3,25 |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 04.05.2020 | IE00BK527S75 | (3,49) | – | – |
| Thesaurierende Klasse GBP Z | 04.12.2019 | IE00BG0WMX45 | (1,12) | (0,21) | 5,56 |
| Thesaurierende Klasse SEK I | 11.12.2019 | IE00BK70Z742 | (1,93) | (1,94) | 3,50 |
| Ausschüttende Klasse SEK I | 20.10.2021 | IE00BL1GVW28 | (1,23) | (1,83) | 3,49 |
| Thesaurierende Klasse USD I | 04.12.2019 | IE00BK70Z528 | (1,62) | (0,51) | 5,69 |
| Thesaurierende Klasse USD X | 04.12.2019 | IE00BK96H638 | (1,11) | – | – |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 04.12.2019 | IE00BK70Z411 | (0,91) | – | 6,30 |

Multi-Asset Income*

| | | | | | |
|------------------------------|------------|--------------|------|---------|---|
| Thesaurierende Klasse EUR I | 13.12.2019 | IE00BKTC3418 | 6,41 | – | – |
| Ausschüttende Klasse GBP P | 27.02.2020 | IE00BKKJBN69 | 7,13 | (12,68) | – |
| Thesaurierende Klasse USD A | 28.02.2018 | IE00BYW7V037 | 6,70 | (12,47) | – |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 01.03.2018 | IE00BF47NK24 | 5,56 | (13,25) | – |
| Thesaurierende Klasse USD I | 28.12.2016 | IE00BYX4Q314 | 7,35 | (11,86) | – |
| Ausschüttende Klasse USD I | 28.12.2016 | IE00BYX4Q421 | 7,30 | (11,76) | – |

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

Multi-Asset Income* (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum 31. Dezember

| Anteilklasse | Auflegungsdatum | ISIN | Geschäftsjahr zum 31. Dezember | | |
|------------------------------|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
| | | | 2021 % | 2022 % | 2023 % |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 08.09.2021 | IE00L8RADS7 | 0,80 | – | – |
| Thesaurierende Klasse USD M | 09.08.2017 | IE00BYMJ8K84 | 5,76 | (13,15) | – |

* Das Portfolio wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

Next Generation Mobility

| | | | | | |
|---|------------|--------------|-------|---------|-------|
| Thesaurierende Klasse EUR A | 07.09.2018 | IE00BD6J9V56 | 21,59 | (29,83) | 25,13 |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 13.01.2021 | IE00BN6HJT78 | 16,00 | (29,22) | 26,19 |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | 24.06.2020 | IE00BKPHW879 | 33,44 | (21,37) | 25,09 |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | 26.10.2018 | IE00BD6JB422 | 31,25 | (22,68) | 23,03 |
| Thesaurierende Klasse USD A | 11.09.2018 | IE00BD6J9T35 | 22,92 | (26,86) | 28,40 |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 21.05.2019 | IE00BHR06368 | 21,67 | (27,53) | 27,05 |
| Thesaurierende Klasse USD I | 21.08.2018 | IE00BFY81J05 | 24,03 | (26,22) | 29,43 |
| Ausschüttende Klasse USD I | 21.08.2018 | IE00BFLTYG40 | 23,98 | (26,20) | 29,46 |
| Thesaurierende Klasse USD M | 21.05.2019 | IE00BHR06475 | 21,91 | (27,44) | 27,44 |
| Thesaurierende Klasse USD X | 23.01.2019 | IE00BGQVSN72 | 23,14 | (26,74) | 28,55 |

Next Generation Space Economy²

| | | | | | |
|--|------------|--------------|---|--------|-------|
| Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert) | 10.05.2022 | IE000KBH8HE5 | – | (4,90) | 23,24 |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | 10.05.2022 | IE000RHGM613 | – | (6,10) | 20,98 |
| Thesaurierende Klasse USD I | 10.05.2022 | IE000PK18K22 | – | (3,90) | 27,26 |

Responsible Asian Debt – Hard Currency

| | | | | | |
|---|------------|--------------|--------|---------|------|
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 30.06.2015 | IE00BYZS6L96 | (1,87) | (13,91) | 5,82 |
| Thesaurierende Klasse USD A | 30.06.2015 | IE00BYZS6K89 | (1,84) | (13,94) | 5,82 |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 15.10.2019 | IE00BJ023P46 | (2,86) | (14,82) | 4,72 |
| Thesaurierende Klasse USD I | 30.06.2015 | IE00BYZS6J74 | (1,27) | (13,50) | 6,45 |
| Ausschüttende Klasse USD I | 30.06.2015 | IE00BYZS6M04 | (1,23) | (13,41) | 6,46 |
| Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich) | 23.09.2022 | IE000BMKOID8 | – | 2,30 | 6,70 |
| Thesaurierende Klasse USD I4 | 23.09.2022 | IE000D2XZZ12 | – | 2,30 | 6,74 |
| Thesaurierende Klasse USD M | 14.08.2019 | IE00BF47N027 | (2,45) | (14,48) | 5,19 |
| Ausschüttende Klasse USD X (Monatlich) | 23.09.2022 | IE000Q9J0UE2 | – | 2,10 | 5,97 |
| Thesaurierende Klasse USD X | 08.06.2021 | IE00BN6JC501 | (1,30) | (13,48) | 5,97 |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 12.12.2022 | IE00BYTHKK92 | – | 0,10 | 7,09 |

Short Duration Emerging Market Debt

| | | | | | |
|--|------------|--------------|--------|--------|------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | 31.08.2016 | IE00BMN93860 | (0,77) | (8,23) | 6,06 |
| Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich) | 06.11.2015 | IE00BMN93G40 | (0,61) | (7,71) | 6,84 |
| Thesaurierende Klasse CHF A | 06.06.2014 | IE00BDZRWQ63 | (1,54) | (9,78) | 3,36 |
| Ausschüttende Klasse CHF A | 06.06.2014 | IE00BDZRWR70 | (1,54) | (9,73) | 3,32 |

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

| Anteilklasse | Auflegungsdatum | ISIN | Geschäftsjahr zum 31. Dezember | | |
|--|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
| | | | 2021 % | 2022 % | 2023 % |
| Thesaurierende Klasse CHF I | 06.06.2014 | IE00BDZRWS87 | (1,02) | (9,31) | 3,84 |
| Ausschüttende Klasse CHF I | 13.06.2014 | IE00BDZRWT94 | (1,02) | (9,35) | 3,84 |
| Thesaurierende Klasse CHF I2 | 20.02.2015 | IE00BDZRWW17 | (0,91) | (9,23) | 3,96 |
| Ausschüttende Klasse CHF I2 | 18.04.2017 | IE00BNJZW449 | (0,96) | (9,17) | 3,94 |
| Thesaurierende Klasse CHF I5 | 31.03.2014 | IE00BDZRWX31 | (0,81) | (9,16) | 4,19 |
| Thesaurierende Klasse CHF P | 25.04.2017 | IE00BVJF0P79 | (1,06) | (9,25) | 3,86 |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 13.06.2014 | IE00BDZRWZ54 | (1,40) | (9,48) | 5,34 |
| Ausschüttende Klasse EUR A | 06.06.2014 | IE00BDZR078 | (1,30) | (9,51) | 5,35 |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 06.06.2014 | IE00BDZR185 | (0,90) | (9,02) | 5,81 |
| Ausschüttende Klasse EUR I | 06.06.2014 | IE00BDZR292 | (0,92) | (8,91) | 5,72 |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 23.06.2014 | IE00BDZR300 | (0,72) | (8,96) | 5,86 |
| Ausschüttende Klasse EUR I2 | 30.03.2017 | IE00BDZR417 | (0,80) | (8,89) | 5,82 |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 14.03.2014 | IE00BDZR524 | (0,61) | (8,83) | 6,14 |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 29.01.2016 | IE00BWB95M67 | (1,99) | (9,94) | 4,61 |
| Ausschüttende Klasse EUR M | 29.01.2016 | IE00BWB93N35 | (1,93) | (9,94) | 4,56 |
| Thesaurierende Klasse EUR P | 23.02.2017 | IE00BYXJQV46 | (0,85) | (9,04) | 5,86 |
| Thesaurierende Klasse EUR U | 06.06.2018 | IE00BNJZW555 | (1,14) | (9,19) | 5,48 |
| Ausschüttende Klasse EUR X | 16.03.2020 | IE00BL6THB70 | (0,77) | (8,92) | 5,92 |
| Thesaurierende Klasse GBP A | 22.11.2016 | IE00BDZR748 | (0,73) | (8,00) | 6,90 |
| Thesaurierende Klasse GBP I | 16.12.2016 | IE00BDZR961 | (0,18) | (7,54) | 7,38 |
| Ausschüttende Klasse GBP I | 20.02.2018 | IE00BDZRB85 | (0,22) | (7,54) | 7,43 |
| Thesaurierende Klasse GBP I2 | 30.09.2016 | IE00BDZRC92 | (0,09) | (7,46) | 7,48 |
| Ausschüttende Klasse GBP I2 | 19.10.2017 | IE00BDZRD00 | (0,19) | (7,43) | 7,47 |
| Ausschüttende Klasse GBP I5 | 11.04.2014 | IE00BDZRG31 | 0,05 | (7,29) | 7,59 |
| Thesaurierende Klasse GBP P | 13.08.2019 | IE00BGV7J266 | (0,29) | (7,46) | 7,45 |
| Ausschüttende Klasse GBP P | 05.02.2021 | IE00BM9TKP66 | (0,71) | – | – |
| Thesaurierende Klasse JPY I | 23.02.2015 | IE00BDZR76 | (0,41) | (9,09) | 2,10 |
| Ausschüttende Klasse JPY I | 22.09.2014 | IE00BDZRL83 | (0,41) | (9,09) | 2,10 |
| Thesaurierende Klasse SEK A | 02.02.2018 | IE00BF18PM41 | (1,03) | (9,09) | 5,45 |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 31.10.2014 | IE00BMN94165 | (0,50) | (7,66) | 5,98 |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 31.10.2014 | IE00BMN94611 | (0,53) | (7,54) | 7,45 |
| Thesaurierende Klasse USD A | 06.12.2013 | IE00BDZRR46 | (0,57) | (7,53) | 7,53 |
| Ausschüttende Klasse USD A | 06.06.2014 | IE00BDZRS52 | (0,52) | (7,55) | 7,51 |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 29.08.2017 | IE00BFH58D19 | (1,58) | (8,47) | 6,48 |
| Ausschüttende Klasse USD C1 | 29.08.2017 | IE00BF2DC271 | (1,53) | (8,45) | 6,46 |
| Thesaurierende Klasse USD I | 31.10.2013 | IE00BDZRT69 | – | (7,09) | 8,06 |
| Ausschüttende Klasse USD I | 02.06.2016 | IE00BDZR9W98 | (0,01) | (7,07) | 8,04 |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 12.09.2014 | IE00BDZRY13 | 0,08 | (6,99) | 8,12 |
| Ausschüttende Klasse USD I2 | 30.10.2015 | IE00BDZRY043 | 0,09 | (6,99) | 8,15 |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 19.03.2014 | IE00BDZRY266 | 0,23 | (6,84) | 8,35 |
| Ausschüttende Klasse USD I5 | 09.10.2014 | IE00BDZRY597 | 0,29 | (6,87) | 8,25 |

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum 31. Dezember

| Anteilklasse | Auflegungsdatum | ISIN | Geschäftsjahr zum 31. Dezember | | |
|-----------------------------|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
| | | | 2021 % | 2022 % | 2023 % |
| Thesaurierende Klasse USD M | 24.08.2017 | IE00BDFBKQ44 | (1,10) | (8,13) | 6,84 |
| Ausschüttende Klasse USD M | 29.08.2017 | IE00BDFBKR50 | (1,06) | (8,11) | 6,84 |
| Thesaurierende Klasse USD P | 10.08.2015 | IE00BTKH9Z19 | – | (7,08) | 8,06 |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 01.04.2014 | IE00BKMMWB06 | 0,46 | (6,60) | 8,54 |

Short Duration High Yield SDG Engagement

| | | | | | |
|--|------------|--------------|------|--------|-------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | 11.06.2013 | IE00B8DK4D30 | 2,94 | (5,86) | 7,63 |
| Thesaurierende Klasse CHF A | 09.03.2012 | IE00B7FN4Q69 | 2,21 | (7,17) | 4,84 |
| Thesaurierende Klasse CHF I | 20.12.2011 | IE00B7FN4P52 | 2,89 | (6,66) | 5,50 |
| Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) | 01.08.2012 | IE00B8474M21 | 5,95 | (4,07) | 6,21 |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 20.12.2011 | IE00B7FN4G61 | 2,45 | (6,92) | 6,91 |
| Ausschüttende Klasse EUR A | 14.02.2014 | IE00B51MHK83 | 2,54 | (7,02) | 6,99 |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 20.12.2011 | IE00B7FN4F54 | 3,05 | (6,38) | 7,56 |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 05.12.2012 | IE00B83NML60 | 3,21 | (6,30) | 7,71 |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 29.01.2016 | IE00BWB93P58 | 1,79 | (7,49) | 6,29 |
| Ausschüttende Klasse EUR M | 29.01.2016 | IE00BWB93Q65 | 1,84 | (7,54) | 6,39 |
| Thesaurierende Klasse GBP I | 17.01.2012 | IE00B7FN4H78 | 3,66 | (4,91) | 9,26 |
| Ausschüttende Klasse GBP I | 20.12.2011 | IE00B7FN4M22 | 3,76 | (5,06) | 9,38 |
| Thesaurierende Klasse GBP I2 | 05.12.2012 | IE00B87CZ321 | 3,79 | (4,82) | 9,31 |
| Ausschüttende Klasse GBP I2 | 05.12.2012 | IE00B7NK7601 | 3,85 | (4,88) | 9,44 |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) | 21.09.2022 | IE0000C39ZN4 | – | 0,93 | 8,25 |
| Thesaurierende Klasse JPY I | 28.03.2012 | IE00B7FN4K08 | 3,53 | (6,41) | 3,75 |
| Ausschüttende Klasse JPY I | 19.10.2022 | IE00BF0BZ353 | – | 1,47 | 3,78 |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 17.01.2014 | IE00B6RMD591 | 3,29 | (5,08) | 7,74 |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 22.01.2014 | IE00B7FN5305 | 3,33 | (4,73) | 9,25 |
| Thesaurierende Klasse USD A | 20.12.2011 | IE00B7FN4D31 | 3,30 | (4,79) | 9,31 |
| Ausschüttende Klasse USD A | 30.11.2012 | IE00B7FN5073 | 3,32 | (4,83) | 9,25 |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 02.10.2017 | IE00BDFBKS67 | 2,25 | (5,79) | 8,19 |
| Thesaurierende Klasse USD I | 20.12.2011 | IE00B7FN4C24 | 3,91 | (4,18) | 9,93 |
| Ausschüttende Klasse USD I | 09.01.2012 | IE00B7FN4Z50 | 3,84 | (4,15) | 9,94 |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 05.12.2012 | IE00B8110967 | 4,03 | (4,17) | 10,14 |
| Ausschüttende Klasse USD I2 | 05.12.2012 | IE00B8K3ZX25 | 4,04 | (4,15) | 10,02 |
| Thesaurierende Klasse USD I4 | 10.05.2023 | IE00094GH437 | – | – | 6,60 |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 08.09.2022 | IE000QHA8X05 | – | 0,40 | 10,26 |
| Thesaurierende Klasse USD M | 25.08.2017 | IE00BDFBKT74 | 2,67 | (5,38) | 8,63 |
| Ausschüttende Klasse USD M | 20.12.2017 | IE00BDFBKV96 | 2,61 | (5,37) | 8,68 |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 01.04.2014 | IE00BKJ9TG65 | 4,54 | (3,66) | 10,60 |

Strategic Income

| | | | | | |
|--|------------|--------------|------|---------|------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | 15.09.2017 | IE00BRJFZ213 | 1,85 | (11,58) | 6,42 |
|--|------------|--------------|------|---------|------|

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

Strategic Income (Fortsetzung)

| Anteilklasse | Auflegungsdatum | ISIN | Geschäftsjahr zum 31. Dezember | | |
|---|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
| | | | 2021 % | 2022 % | 2023 % |
| Ausschüttende Klasse AUD Z (Monatlich) | 01.07.2019 | IE00BH3W6Z85 | 2,88 | (10,76) | 7,55 |
| Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) | 31.05.2023 | IE00BRJFZS74 | – | – | 4,01 |
| Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) | 07.08.2017 | IE00BQR9PJ58 | 1,18 | (12,73) | 5,95 |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 14.11.2022 | IE0004VYIY29 | – | 0,50 | 5,87 |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 22.01.2016 | IE00B9154717 | 1,75 | (12,32) | 6,46 |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 29.01.2016 | IE00BWB97642 | 0,71 | (13,29) | 5,28 |
| Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich) | 15.09.2017 | IE00BRJFZD22 | 1,91 | (11,37) | 7,61 |
| Ausschüttende Klasse GBP I (Monatlich) | 06.12.2023 | IE00BRJFZF46 | – | – | 2,30 |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) | 15.09.2017 | IE00BRJFZH69 | 2,10 | (11,15) | 7,28 |
| Thesaurierende Klasse JPY I | 26.04.2013 | IE00B9F63958 | 2,27 | (12,44) | 2,49 |
| Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert) | 26.04.2013 | IE00B9C7XK23 | 14,52 | 2,90 | 16,30 |
| Ausschüttende Klasse JPY I CG | 10.08.2015 | IE00BYZFYQ11 | 2,27 | (12,44) | 2,49 |
| Ausschüttende Klasse JPY I | 25.06.2014 | IE00BNCBRC28 | 2,27 | (12,44) | 2,56 |
| Thesaurierende Klasse JPY Z | 01.04.2022 | IE000U3RQH4 | – | (8,46) | 3,00 |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 31.10.2014 | IE00BRJFZM13 | 2,17 | (10,99) | 6,79 |
| Thesaurierende Klasse SGD A | 15.09.2017 | IE00BQSBQV90 | 2,10 | (10,94) | 6,73 |
| Ausschüttende Klasse SGD I (Monatlich) | 04.06.2018 | IE00BDFDPD26 | 2,64 | (10,48) | 7,27 |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 31.10.2014 | IE00B7BTH691 | 2,14 | (10,63) | 8,34 |
| Thesaurierende Klasse USD A | 11.02.2015 | IE00B87L2R26 | 2,17 | (10,61) | 8,27 |
| Ausschüttende Klasse USD A | 10.08.2016 | IE00BD0PCD21 | 2,14 | (10,62) | 8,24 |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 25.08.2017 | IE00BDFBLQ19 | 1,07 | (11,51) | 7,21 |
| Thesaurierende Klasse USD I | 26.04.2013 | IE00B8HX1V50 | 2,70 | (10,24) | 8,88 |
| Ausschüttende Klasse USD I | 10.12.2014 | IE00B9DN9Q73 | 2,65 | (10,19) | 8,87 |
| Thesaurierende Klasse USD M | 18.02.2016 | IE00BD9WHS47 | 1,59 | (11,18) | 7,66 |
| Ausschüttende Klasse USD M | 25.08.2017 | IE00BDFBLR26 | 1,55 | (11,16) | 7,64 |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 30.06.2014 | IE00BKMKVY67 | 3,16 | (9,69) | 9,36 |

Sustainable Asia High Yield

| | | | | | |
|--|------------|--------------|--------|---------|------|
| Thesaurierende Klasse EUR X | 28.01.2022 | IE0009LNQCG8 | – | (14,90) | 0,12 |
| Thesaurierende Klasse GBP X | 08.04.2022 | IE0002USV3J1 | – | (6,90) | 1,72 |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 13.12.2021 | IE0003AW7W04 | (1,00) | (16,64) | 1,47 |
| Thesaurierende Klasse USD A | 13.12.2021 | IE000I98A7B6 | (1,00) | (16,36) | 1,45 |
| Thesaurierende Klasse USD I | 13.12.2021 | IE000RBQOOF7 | (1,00) | (15,76) | 2,04 |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 21.01.2022 | IE000I87JBO0 | – | (13,43) | 2,64 |
| Ausschüttende Klasse USD Z | 22.03.2022 | IE000HTH7XL4 | – | (2,84) | 2,56 |

Sustainable Emerging Market Corporate Debt

| | | | | | |
|------------------------------|------------|--------------|--------|---------|------|
| Thesaurierende Klasse CHF I | 28.06.2013 | IE00B97C6C50 | (1,84) | (14,24) | 3,74 |
| Thesaurierende Klasse CHF I4 | 05.11.2019 | IE00BK70Z858 | (1,53) | (13,94) | – |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 17.12.2015 | IE00B984JD20 | (2,51) | (14,60) | 4,73 |

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Corporate Debt (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum 31. Dezember

| Anteilklasse | Auflegungsdatum | ISIN | Geschäftsjahr zum 31. Dezember | | |
|--|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
| | | | 2021 % | 2022 % | 2023 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 28.06.2013 | IE00B984JG50 | (1,63) | (13,94) | 5,69 |
| Thesaurierende Klasse EUR I3 | 29.07.2016 | IE00BD3H7L85 | (1,40) | (13,64) | 5,95 |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 18.02.2016 | IE00BWB97F31 | (3,19) | (15,32) | 3,89 |
| Ausschüttende Klasse EUR M | 18.02.2016 | IE00BWB97G48 | (3,20) | (15,23) | 3,81 |
| Thesaurierende Klasse EUR X | 20.07.2015 | IE00BXDZNR08 | (1,15) | (13,59) | 6,08 |
| Thesaurierende Klasse GBP I | 28.06.2013 | IE00B984KJ54 | (0,98) | (12,60) | 7,29 |
| Thesaurierende Klasse SEK A | 01.02.2018 | IE00BYMJ8H55 | (2,06) | (14,29) | 4,96 |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 31.10.2014 | IE00B984MC26 | (1,57) | (12,64) | 6,95 |
| Thesaurierende Klasse USD A | 28.06.2013 | IE00B984MH70 | (1,54) | (12,76) | 7,03 |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 29.08.2017 | IE00BDFBJC35 | (2,53) | (13,70) | 6,01 |
| Thesaurierende Klasse USD I | 28.06.2013 | IE00B984QG44 | (0,73) | (12,06) | 7,88 |
| Ausschüttende Klasse USD I | 28.06.2013 | IE00B984QK89 | (0,77) | (12,07) | 7,90 |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 25.03.2015 | IE00B984N180 | (0,66) | (11,89) | 8,05 |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 11.06.2014 | IE00BCFFV006 | (0,43) | (11,68) | – |
| Thesaurierende Klasse USD M | 03.10.2017 | IE00BDFBJD42 | (2,43) | (13,39) | 6,08 |
| Ausschüttende Klasse USD M | 03.11.2017 | IE00BDFBJF65 | (2,34) | (13,41) | 6,16 |

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency²

| | | | | | |
|------------------------------|------------|--------------|---|---------|-------|
| Thesaurierende Klasse EUR I3 | 26.09.2022 | IE000I1CMUN9 | – | 7,90 | 10,75 |
| Thesaurierende Klasse EUR I4 | 13.04.2023 | IE000LAZMZ05 | – | – | 8,30 |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 28.12.2022 | IE000WNKM6C0 | – | 0,10 | – |
| Thesaurierende Klasse EUR X | 19.01.2022 | IE000ROI8ND2 | – | (16,40) | 10,89 |
| Thesaurierende Klasse USD I | 19.01.2022 | IE000FZALWJ6 | – | (14,60) | 13,11 |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 27.01.2022 | IE0007IY0WW3 | – | (14,50) | 13,57 |

Tactical Macro¹

| | | | | | |
|------------------------------|------------|--------------|---|---|------|
| Thesaurierende Klasse USD I | 30.06.2023 | IE000PD59QT4 | – | – | 2,20 |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 30.06.2023 | IE000Y16CQ19 | – | – | 2,40 |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 30.06.2023 | IE000VOK74I4 | – | – | 2,60 |

Ultra Short Term Euro Bond

| | | | | | |
|------------------------------|------------|--------------|--------|--------|------|
| Thesaurierende Klasse CHF P | 30.05.2022 | IE000BN78WH6 | – | (2,52) | 4,68 |
| Thesaurierende Klasse CHF U | 17.12.2019 | IE00BL1GVV11 | 0,66 | (5,84) | 4,57 |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 10.06.2021 | IE00BNG2T811 | (0,17) | (5,75) | 6,52 |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 31.10.2018 | IE00BFZMJT78 | 1,04 | (5,59) | 6,72 |
| Ausschüttende Klasse EUR I | 31.10.2018 | IE00BFZMJS61 | 1,03 | (5,58) | 6,71 |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 27.02.2020 | IE00BKLC3S38 | 1,07 | (5,55) | 6,76 |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 06.02.2019 | IE00BHR3GK28 | 1,12 | (5,49) | 6,83 |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 29.07.2021 | IE000XRSHD49 | (0,50) | (6,31) | 6,18 |
| Thesaurierende Klasse EUR U | 17.12.2019 | IE00BL1GVT98 | 0,94 | (5,68) | 6,61 |

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

Ultra Short Term Euro Bond (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum 31. Dezember

| Anteilklasse | Auflegungsdatum | ISIN | Geschäftsjahr zum 31. Dezember | | |
|-----------------------------|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
| | | | 2021 % | 2022 % | 2023 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Z | 20.12.2018 | IE00BH453S87 | 1,21 | (5,38) | 6,93 |
| Thesaurierende Klasse USD I | 15.09.2021 | IE000WMR7CB5 | (0,05) | (3,62) | 8,93 |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 24.01.2019 | IE00BH453T94 | 2,01 | (3,43) | 9,12 |

Uncorrelated Strategies

| | | | | | |
|------------------------------|------------|--------------|--------|--------|---------|
| Thesaurierende Klasse CHF I | 13.03.2018 | IE00BF2F4M73 | (1,62) | 6,38 | (12,28) |
| Thesaurierende Klasse CHF I5 | 08.09.2017 | IE00BZ3CG211 | (1,37) | 6,87 | – |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 20.08.2018 | IE00BDC3ND11 | (2,16) | 5,78 | (11,22) |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 06.03.2018 | IE00BF2F4L66 | (1,50) | 6,59 | (10,56) |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 06.07.2017 | IE00BD5BKL97 | (1,36) | 6,79 | (10,41) |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 31.05.2017 | IE00BF076079 | (1,15) | 7,00 | – |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 15.09.2017 | IE00BDC3NF35 | (3,00) | 4,91 | (11,90) |
| Thesaurierende Klasse EUR P | 05.07.2022 | IE00093NGSP5 | – | (1,50) | (10,36) |
| Thesaurierende Klasse GBP I | 30.06.2017 | IE00BF47M490 | (0,84) | 8,58 | (9,11) |
| Thesaurierende Klasse GBP I2 | 06.07.2017 | IE00BD5BKG45 | (0,75) | 8,75 | (9,00) |
| Ausschüttende Klasse GBP I2 | 30.08.2022 | IE000R82ESQ2 | – | (0,40) | (8,94) |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 | 31.05.2017 | IE00BF076186 | (0,55) | 9,01 | (8,69) |
| Thesaurierende Klasse GBP P | 02.10.2018 | IE00BFXBF434 | (0,87) | 8,67 | (9,05) |
| Thesaurierende Klasse GBP Z | 29.06.2017 | IE00BYQDD455 | (0,18) | 9,47 | (8,40) |
| Thesaurierende Klasse JPY I | 01.04.2022 | IE00BYQDD349 | – | 2,99 | (13,79) |
| Thesaurierende Klasse SGD A | 13.04.2023 | IE00BGR6TZ09 | – | 0,55 | (3,25) |
| Thesaurierende Klasse USD A | 26.01.2018 | IE00BF076L85 | (1,44) | 7,50 | (9,52) |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 06.03.2018 | IE00BYW7V144 | (2,46) | 6,55 | (10,50) |
| Thesaurierende Klasse USD I | 31.05.2017 | IE00BF075X33 | (0,72) | 8,33 | (8,86) |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 06.07.2017 | IE00BD5BKM05 | (0,63) | 8,49 | (8,66) |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 31.05.2017 | IE00BF07FG69 | (0,35) | 8,72 | (8,51) |
| Thesaurierende Klasse USD M | 09.08.2017 | IE00BZ3CG328 | (2,20) | 6,66 | (10,28) |
| Thesaurierende Klasse USD P | 12.12.2018 | IE00BFZPTC98 | (0,65) | 8,36 | (8,92) |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 08.09.2017 | IE00BF23SS52 | – | 9,22 | (8,20) |

Uncorrelated Trading*

| | | | | | |
|-----------------------------|------------|--------------|---|--------|---|
| Thesaurierende Klasse EUR X | 14.06.2022 | IE000L1JDD81 | – | (1,70) | – |
| Thesaurierende Klasse USD X | 6/22/2022 | IE0003VEJ409 | – | 0,00 | – |

* Das Portfolio wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

US Equity

| | | | | | |
|------------------------------|------------|--------------|-------|---------|-------|
| Thesaurierende Klasse JPY I3 | 01.03.2022 | IE000XSV3WB9 | – | (18,40) | 29,66 |
| Thesaurierende Klasse USD A | 27.03.2020 | IE00BHR06814 | 20,67 | (26,57) | 35,83 |
| Thesaurierende Klasse USD I | 18.12.2015 | IE00BD34ZN73 | 21,58 | (26,01) | 36,82 |

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

US Equity (Fortsetzung)

| Anteilklasse | Auflegungsdatum | ISIN | Geschäftsjahr zum 31. Dezember | | |
|-----------------------------|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
| | | | 2021 % | 2022 % | 2023 % |
| Ausschüttende Klasse USD I | 18.12.2015 | IE00BD350682 | 21,57 | (26,03) | 36,87 |
| Thesaurierende Klasse USD M | 09.02.2022 | IE00BHR06B44 | – | (22,60) | 34,75 |

US Equity Index PutWrite

| | | | | | |
|--|------------|---------------|-------|---------|-------|
| Thesaurierende Klasse EUR I | 13.02.2017 | IE00BYX7LW42 | 17,26 | (13,09) | 12,83 |
| Ausschüttende Klasse EUR I3 | 03.12.2021 | IE000NHZGVS8 | 3,80 | (12,93) | 13,03 |
| Thesaurierende Klasse EUR I4 | 28.04.2017 | IE00BD4H0968 | 17,59 | (12,86) | 13,13 |
| Ausschüttende Klasse EUR I4 | 15.12.2023 | IE000HG9AHM4 | – | – | 0,70 |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 13.02.2017 | IE00BYX7LX58 | 15,76 | (14,33) | 11,34 |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | 02.03.2017 | IE00BYWPKN37 | 19,47 | 0,59 | 8,91 |
| Thesaurierende Klasse GBP I3 | 11.05.2021 | IE00BMWPKY46 | 14,90 | 0,78 | 9,07 |
| Ausschüttende Klasse GBP I3 | 03.12.2021 | IE00BMD7ZC88 | 3,71 | (11,73) | 14,82 |
| Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert) | 21.06.2023 | IE0007M7EB22 | – | – | 5,00 |
| Thesaurierende Klasse GBP I4 | 28.04.2017 | IE00BD4H0851 | 18,06 | – | – |
| Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) | 25.10.2017 | IE00BYXH8345 | 19,78 | 0,86 | 9,11 |
| Ausschüttende Klasse GBP I4 | 29.11.2023 | IE00BD3DV701 | 18,21 | – | 2,40 |
| Ausschüttende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | 25.08.2021 | IE000EORQCL4 | 5,06 | 0,64 | 8,96 |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 15.08.2017 | IE00BDRKGH20 | 17,51 | (11,67) | 13,13 |
| Thesaurierende Klasse USD A | 23.01.2017 | IE00BDDWGC76 | 17,51 | (11,16) | 14,70 |
| Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) | 18.05.2017 | IE00BD461232 | 18,32 | (10,66) | 15,43 |
| Thesaurierende Klasse USD I | 30.12.2016 | IE00BDDWGG831 | 18,36 | (10,63) | 15,39 |
| Thesaurierende Klasse USD I3 | 24.08.2018 | IE00BYXH8121 | 18,43 | – | – |
| Ausschüttende Klasse USD I3 | 03.12.2021 | IE000VHERIO9 | 3,90 | (10,45) | 15,53 |
| Thesaurierende Klasse USD I4 | 28.04.2017 | IE00BD4H0B82 | 18,63 | (10,44) | 15,65 |
| Thesaurierende Klasse USD M | 13.02.2017 | IE00BYX7LY65 | 16,79 | (11,87) | 13,80 |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 10.02.2017 | IE00BDDWGF08 | 19,15 | (10,11) | 16,08 |

US Large Cap Value

| | | | | | |
|--|------------|--------------|---|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR A | 19.10.2022 | IE000F8FR4R1 | – | 8,70 | (5,70) |
| Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) | 21.06.2022 | IE000JHJ5WY3 | – | 6,80 | (6,74) |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 30.03.2022 | IE000NZY26Q1 | – | (8,00) | (4,89) |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | 19.04.2022 | IE000COXIH6 | – | (5,80) | (5,94) |
| Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) | 22.03.2022 | IE000ALURE78 | – | (0,90) | (5,62) |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) | 27.01.2022 | IE000SK5XXE9 | – | 4,20 | (5,57) |
| Thesaurierende Klasse GBP I | 22.11.2022 | IE000I4SVYD3 | – | (2,40) | (3,38) |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | 22.11.2022 | IE00001H49K2 | – | (3,40) | (8,07) |
| Ausschüttende Klasse GBP I | 22.11.2022 | IE000YZ914N6 | – | (2,40) | (3,39) |
| Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | 22.11.2022 | IE000EA4KHA8 | – | (3,40) | (8,20) |
| Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) | 14.03.2022 | IE0005DYIEB4 | – | 9,20 | (7,87) |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | 08.06.2022 | IE0004QFE496 | – | 2,80 | (8,17) |

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

US Large Cap Value (Fortsetzung)

| Anteilklasse | Auflegungsdatum | ISIN | Geschäftsjahr zum 31. Dezember | | |
|---|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
| | | | 2021 % | 2022 % | 2023 % |
| Ausschüttende Klasse GBP P | 21.10.2022 | IE000VWPWUH3 | – | 6,30 | (3,37) |
| Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert) | 24.05.2022 | IE000YILQ9A8 | – | 4,80 | (8,11) |
| Ausschüttende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert) | 30.08.2022 | IE000NVIOWF0 | – | 2,90 | (8,02) |
| Thesaurierende Klasse USD A | 24.03.2022 | IE000M9KFDE8 | – | (5,00) | (3,37) |
| Thesaurierende Klasse USD I | 20.12.2021 | IE0003JM1523 | 3,90 | (1,06) | (2,63) |
| Ausschüttende Klasse USD I4 | 21.03.2022 | IE000CGMU1E8 | – | (3,70) | (2,34) |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 11.02.2022 | IE000429UF11 | – | (3,50) | (2,28) |
| Thesaurierende Klasse USD M | 25.03.2022 | IE000E4YYWX1 | – | (6,50) | (4,28) |
| Thesaurierende Klasse USD Y | 08.08.2023 | IE000D0QTQS8 | – | – | (1,10) |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 23.05.2022 | IE0008OYN7T5 | – | 1,00 | (1,98) |

US Long Short Equity

| | | | | | |
|--|------------|--------------|-------|---------|-------|
| Thesaurierende Klasse EUR A | 06.07.2015 | IE00BPRC5K89 | 2,73 | (10,81) | 10,00 |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 01.12.2014 | IE00BJTD3X67 | 3,74 | (10,02) | 11,05 |
| Thesaurierende Klasse EUR I3 | 13.05.2020 | IE00BMYMJT70 | 4,20 | (9,68) | 11,48 |
| Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert) | 13.05.2020 | IE00BMYMJS63 | 13,11 | – | – |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 04.12.2015 | IE00BWB95R13 | 1,95 | (11,45) | 9,11 |
| Thesaurierende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert) | 13.05.2020 | IE00BMYMJR56 | 6,05 | – | – |
| Ausschüttende Klasse GBP I3 | 08.09.2020 | IE00BMXNP376 | 4,77 | (8,20) | 13,23 |
| Thesaurierende Klasse SGD A1 | 31.10.2014 | IE00BJTD4N35 | 3,89 | (8,70) | 11,31 |
| Thesaurierende Klasse USD A (PF) | 10.06.2015 | IE00BWB95Q06 | 3,24 | (8,01) | 12,29 |
| Thesaurierende Klasse USD A | 24.02.2015 | IE00BVYJ5W68 | 3,68 | (8,56) | 12,39 |
| Thesaurierende Klasse USD A1 | 03.04.2014 | IE00BJTD4V19 | 3,92 | (8,28) | 12,75 |
| Ausschüttende Klasse USD I (PF) | 13.03.2015 | IE00BV9FSD10 | 4,07 | (7,36) | 12,83 |
| Thesaurierende Klasse USD I | 28.02.2014 | IE00BJTCX997 | 4,66 | (7,67) | 13,34 |
| Thesaurierende Klasse USD I3 | 13.05.2020 | IE00BMYMKR20 | 5,05 | (7,26) | 13,83 |
| Thesaurierende Klasse USD M | 09.08.2017 | IE00BZ3CG435 | 2,89 | (9,33) | 11,48 |
| Thesaurierende Klasse USD U | 06.03.2015 | IE00BNJZX306 | 4,17 | (8,15) | 12,91 |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 15.05.2014 | IE00BKKN1160 | 6,06 | (6,47) | 14,97 |

US Multi Cap Opportunities

| | | | | | |
|---|------------|--------------|-------|---------|-------|
| Thesaurierende Klasse AUD E | 02.07.2014 | IE00BNK02N76 | 21,75 | (20,80) | 13,29 |
| Thesaurierende Klasse AUD T | 19.12.2016 | IE00BCDZ0167 | 22,99 | (20,01) | 14,42 |
| Thesaurierende Klasse EUR I3 | 21.03.2013 | IE00B80TLB03 | 24,38 | (19,56) | 15,67 |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 29.01.2016 | IE00BWB95S20 | 21,66 | (21,32) | 13,14 |
| Thesaurierende Klasse EUR1 A | 28.06.2012 | IE00B7F25G09 | 22,90 | (20,53) | 14,31 |
| Thesaurierende Klasse EUR1 I | 28.06.2012 | IE00B84HCB79 | 23,93 | (19,84) | 15,24 |
| Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert) | 06.11.2017 | IE00B7WF5P11 | 26,72 | (6,27) | 11,77 |
| Thesaurierende Klasse SGD A | 16.07.2013 | IE00B3S45H60 | 23,94 | (18,53) | 15,26 |
| Thesaurierende Klasse USD B | 22.11.2013 | IE00BCDZ0381 | 22,83 | (18,72) | 15,79 |

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum 31. Dezember

| Anteilklasse | Auflegungsdatum | ISIN | Geschäftsjahr zum 31. Dezember | | |
|------------------------------|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
| | | | 2021 % | 2022 % | 2023 % |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 13.10.2017 | IE00BDFBKF39 | 22,91 | (18,64) | 15,93 |
| Thesaurierende Klasse USD C2 | 22.11.2013 | IE00BCDZ0506 | 22,77 | (18,68) | 15,84 |
| Thesaurierende Klasse USD E | 02.07.2014 | IE00BNK02L52 | 22,77 | (18,69) | 15,82 |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 24.05.2023 | IE000ZA1BZG7 | – | – | 12,00 |
| Thesaurierende Klasse USD I3 | 29.04.2013 | IE00B87F0588 | 25,64 | (16,78) | 18,48 |
| Ausschüttende Klasse USD I3 | 30.07.2013 | IE00B6W3XJ81 | 25,64 | (16,82) | 18,52 |
| Thesaurierende Klasse USD M | 18.02.2016 | IE00BD9WHM84 | 22,91 | (18,60) | 15,94 |
| Thesaurierende Klasse USD T | 22.11.2013 | IE00BCDZ0720 | 24,02 | (17,85) | 16,91 |
| Thesaurierende Klasse USD U | 22.01.2013 | IE00B819XJ19 | 24,68 | (17,43) | 17,60 |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 02.05.2014 | IE00BKJ9MD40 | 26,28 | (16,38) | 19,08 |
| Thesaurierende Klasse USD1 A | 29.06.2012 | IE00B775SV38 | 24,15 | (17,80) | 17,07 |
| Thesaurierende Klasse USD1 I | 28.06.2012 | IE00B7XCGB41 | 25,19 | (17,11) | 18,10 |
| Ausschüttende Klasse USD1 I | 29.06.2012 | IE00B3RSF130 | 25,22 | (17,10) | 18,06 |
| Thesaurierende Klasse ZAR B | 13.01.2014 | IE00BH2RDW08 | 28,11 | (16,64) | 18,65 |
| Thesaurierende Klasse ZAR C2 | 13.01.2014 | IE00BH2RDX15 | 28,11 | (16,63) | 18,70 |
| Thesaurierende Klasse ZAR E | 02.07.2014 | IE00BNK02M69 | 28,11 | (16,64) | 18,65 |
| Thesaurierende Klasse ZAR T | 13.01.2014 | IE00BH2RDY22 | 29,39 | (15,80) | 19,84 |

US Real Estate Securities

| | | | | | |
|---|------------|--------------|-------|---------|------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | 08.08.2016 | IE00BD0PCG51 | 39,36 | (30,39) | 7,12 |
| Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) | 16.08.2016 | IE00B952Z211 | 37,59 | (31,29) | 5,69 |
| Thesaurierende Klasse AUD B | 19.08.2015 | IE00B8HXG989 | 37,57 | (31,29) | 5,70 |
| Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich) | 16.08.2016 | IE00B955V74 | 37,39 | (31,26) | – |
| Thesaurierende Klasse AUD C2 | 25.09.2015 | IE00B8HXGC10 | 37,51 | – | – |
| Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) | 16.08.2016 | IE00BYN4NT64 | 37,62 | (31,32) | 5,70 |
| Thesaurierende Klasse AUD E | 02.07.2014 | IE00BNK02P90 | 37,51 | (31,30) | 5,68 |
| Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) | 13.10.2015 | IE00B961PR15 | 38,93 | (30,59) | 6,79 |
| Thesaurierende Klasse AUD T | 16.07.2013 | IE00B8HXGG57 | 38,93 | (30,58) | 6,68 |
| Thesaurierende Klasse CHF A | 11.10.2012 | IE00B68CYF25 | 38,51 | (31,16) | 5,03 |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 01.02.2006 | IE00B0T0GT17 | 39,11 | (30,97) | 7,02 |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 01.02.2006 | IE00B0T0GS00 | 39,94 | (30,40) | 7,83 |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 29.01.2016 | IE00BWB97865 | 37,43 | (31,56) | 5,94 |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) | 28.07.2016 | IE00BD0PCF45 | 40,05 | (28,92) | 8,62 |
| Thesaurierende Klasse SGD A | 28.05.2013 | IE00B45NX917 | 40,03 | (29,19) | 7,93 |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 18.11.2015 | IE00B95QR487 | 40,21 | (28,50) | 9,67 |
| Thesaurierende Klasse USD A | 01.02.2006 | IE00B0T0GQ85 | 40,22 | (28,55) | 9,72 |
| Ausschüttende Klasse USD A | 21.03.2012 | IE00B1G9WX41 | 40,18 | (28,53) | 9,70 |
| Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) | 15.08.2016 | IE00B95SNQ81 | 38,34 | (29,45) | 8,32 |
| Thesaurierende Klasse USD B | 16.07.2013 | IE00B8HXHJ53 | 38,38 | (29,46) | 8,31 |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 31.08.2017 | IE00BDFBLK56 | 38,86 | (29,25) | 8,62 |

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

| Anteilklasse | Auflegungsdatum | ISIN | Geschäftsjahr zum 31. Dezember | | |
|--|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
| | | | 2021 % | 2022 % | 2023 % |
| US Real Estate Securities (Fortsetzung) | | | | | |
| Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich) | 16.08.2016 | IE00B95TPW15 | 38,50 | (29,43) | – |
| Thesaurierende Klasse USD C2 | 16.07.2013 | IE00B8HXHK68 | 38,41 | (29,48) | – |
| Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) | 15.08.2016 | IE00BYN4NV86 | 38,34 | (29,45) | 8,32 |
| Thesaurierende Klasse USD E | 02.07.2014 | IE00BNK02Q08 | 38,40 | (29,45) | 8,29 |
| Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) | 19.11.2019 | IE00B955JP96 | 41,30 | (27,96) | 10,48 |
| Thesaurierende Klasse USD I | 01.02.2006 | IE00B0T0GP78 | 41,31 | (28,01) | 10,55 |
| Ausschüttende Klasse USD I | 14.02.2013 | IE00B90CY062 | 41,27 | (28,01) | 10,62 |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 05.12.2012 | IE00B8B20D34 | 41,53 | (27,87) | 10,78 |
| Thesaurierende Klasse USD M | 18.02.2016 | IE00BD9WHN91 | 38,85 | (29,27) | 8,61 |
| Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) | 01.01.2016 | IE00BDD1NC38 | 39,80 | (28,73) | 9,38 |
| Thesaurierende Klasse USD T | 16.07.2013 | IE00B8HXHL75 | 39,80 | (28,76) | 9,40 |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 10.02.2015 | IE00BKJ9MS92 | 42,27 | (27,44) | 11,42 |
| Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich) | 16.08.2016 | IE00BD89KB03 | 44,13 | (27,64) | 10,53 |
| Thesaurierende Klasse ZAR B | 13.03.2015 | IE00BCDYB81 | 44,17 | (27,67) | 10,55 |
| Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich) | 15.08.2016 | IE00BD89K988 | 44,12 | (27,63) | – |
| Thesaurierende Klasse ZAR C2 | 11.04.2019 | IE00BCDYZD06 | 44,19 | (27,67) | 10,56 |
| Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) | 16.08.2016 | IE00BYN4NX01 | 44,14 | (27,63) | 10,53 |
| Thesaurierende Klasse ZAR E | 02.07.2014 | IE00BNK02R15 | 44,18 | (27,67) | 10,55 |
| Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) | 11.06.2013 | IE00BBGB0Y75 | 45,60 | (26,91) | 11,63 |
| Thesaurierende Klasse ZAR T | 26.07.2013 | IE00BCDYZG37 | 45,63 | (26,94) | 11,67 |
| US Small Cap | | | | | |
| Thesaurierende Klasse AUD B | 25.10.2019 | IE00B8HXHQ21 | 14,46 | (22,92) | 10,41 |
| Thesaurierende Klasse AUD C2 | 04.09.2018 | IE00B8HXHT51 | 14,40 | (22,93) | 10,48 |
| Thesaurierende Klasse AUD E | 02.07.2014 | IE00BNK02S22 | 14,39 | (22,88) | 10,39 |
| Thesaurierende Klasse AUD T | 19.12.2016 | IE00B8HXJ447 | 15,50 | (22,13) | 11,54 |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 28.06.2016 | IE00B44F1J46 | 15,49 | (22,62) | 11,45 |
| Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) | 18.09.2020 | IE00B42MJZ94 | 25,64 | (14,66) | 10,45 |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 06.08.2013 | IE00B3PY8J28 | 16,55 | (21,97) | 12,44 |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | 16.10.2017 | IE00B4NQT611 | 26,73 | (13,94) | 11,43 |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert) | 24.01.2019 | IE00BGSF1T43 | 26,88 | (13,79) | 11,53 |
| Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) | 05.05.2022 | IE00NDPFUI3 | – | (1,40) | 11,76 |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 04.02.2016 | IE00BWB97H54 | 14,37 | (23,39) | 10,39 |
| Thesaurierende Klasse EUR Z | 31.03.2016 | IE00BKJB1D33 | 17,52 | (21,31) | 13,39 |
| Ausschüttende Klasse JPY I | 29.07.2011 | IE00B4TSG157 | 31,36 | (7,47) | 23,22 |
| Thesaurierende Klasse USD A | 05.07.2011 | IE00B64QTZ34 | 16,74 | (19,92) | 14,34 |
| Ausschüttende Klasse USD A | 28.11.2016 | IE00BLDYK493 | 16,74 | (19,93) | 14,35 |
| Thesaurierende Klasse USD B | 16.07.2013 | IE00B8HXJT91 | 15,51 | (20,82) | 13,09 |
| Thesaurierende Klasse USD C2 | 16.07.2013 | IE00B8HXK635 | 15,49 | (20,84) | 13,13 |
| Thesaurierende Klasse USD E | 02.07.2014 | IE00BNK02T39 | 15,47 | (20,79) | 13,10 |

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

US Small Cap (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum 31. Dezember

| Anteilklasse | Auflegungsdatum | ISIN | Geschäftsjahr zum 31. Dezember | | |
|------------------------------|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
| | | | 2021 % | 2022 % | 2023 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 01.07.2011 | IE00B66ZT477 | 17,78 | (19,25) | 15,36 |
| Ausschüttende Klasse USD I | 10.12.2013 | IE00BH2RF025 | 17,80 | (19,26) | 15,36 |
| Thesaurierende Klasse USD I3 | 30.07.2018 | IE00B8GCB135 | 18,06 | (19,04) | 15,61 |
| Thesaurierende Klasse USD M | 18.02.2016 | IE00BD9WHP16 | 15,59 | (20,67) | 13,17 |
| Thesaurierende Klasse USD T | 16.07.2013 | IE00B8HXK965 | 16,65 | (20,02) | 14,28 |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 30.08.2016 | IE00BKJ9TJ96 | 18,81 | (18,54) | 16,27 |
| Thesaurierende Klasse ZAR E | 08.08.2017 | IE00BNK02V50 | 20,30 | (18,79) | 15,46 |
| Thesaurierende Klasse ZAR T | 19.12.2016 | IE00BH2RF918 | 21,51 | (17,97) | 16,62 |

US Small Cap Intrinsic Value

| | | | | | |
|--|------------|--------------|-------|---------|-------|
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | 09.03.2021 | IE00BLR75F08 | 12,40 | (10,68) | 7,77 |
| Thesaurierende Klasse GBP I2 (nicht währungsgesichert) | 22.10.2021 | IE000HFERTZ5 | 4,00 | (10,48) | 7,95 |
| Thesaurierende Klasse JPY I3 (nicht währungsgesichert) | 29.08.2023 | IE000YD8EH37 | – | – | 1,25 |
| Thesaurierende Klasse USD A | 04.02.2016 | IE00BY7S3S36 | 25,28 | (21,29) | 13,19 |
| Thesaurierende Klasse USD I | 30.04.2015 | IE00BX1D4S49 | 26,31 | (20,64) | 14,17 |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 16.03.2022 | IE000E90KKM6 | – | (15,60) | 14,45 |
| Thesaurierende Klasse USD M | 27.05.2016 | IE00BYQQ4L83 | 24,04 | (22,08) | 12,03 |

¹ Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

² Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

Anhang III

INFORMATIONEN ÜBER DAS GESAMTRISIKO (UNGEPRÜFT)

Messung des Marktrisikos und des Leverage unter Verwendung des Commitment- und VaR-Ansatzes

Die Portfolios streben eine Begrenzung des durch den Einsatz von Derivaten entstehenden Marktrisikos und Leverage (Hebelung) an, indem sie entweder den Commitment-Ansatz oder eine als Value-at-Risk („VaR“) bekannte komplexe Methode der Risikomessung anwenden. Der 5G Connectivity, China A-Share Equity, China Equity, Climate Innovation, CLO Income, Corporate Hybrid Bond, Developed Market FMP – 2027, Emerging Markets Equity, European High Yield Bond, European Sustainable Equity, Global Diversified Income FMP – 2024, Global Equity Megatrends, Global High Yield ESG Engagement, Global Investment Grade Credit, Global Real Estate Securities, Global Sustainable Equity, Global Sustainable Value, High Yield Bond, InnovAsia 5G, Japan Equity Engagement, Next Generation Mobility, Next Generation Space Economy, Short Duration Emerging Market Debt, Short Duration High Yield ESG Engagement, US Equity, US Large Cap Value, US Multi Cap Opportunities, US Real Estate Securities, US Small Cap und US Small Cap Intrinsic Value enden den Commitment-Ansatz an. Der Commitment-Ansatz berechnet die Hebelung, indem der Marktwert des zugrunde liegenden Derivateengagements im Verhältnis zum NIW des jeweiligen Portfolios gemessen wird. Diese Hebelung wird jedoch zu keinem Zeitpunkt den NIW des Portfolios übersteigen.

Ein Portfolio kann ein „absolutes“ VaR-Modell anwenden, bei dem die Messung des VaR relativ zum Nettoinventarwert des Portfolios erfolgt, oder ein relatives VaR-Modell, bei dem die Messung des VaR im Verhältnis zu einer derivativefreien vergleichbaren Benchmark oder einem äquivalenten Portfolio erfolgt. Das von bestimmten Portfolios verwendete Modell ist in der Spalte „Marktrisiko“ in nachstehender Tabelle angegeben. Die angewandte VaR-Methode unterliegt mehreren Einschränkungen. Erstens basiert der VaR auf einem Modell für Aktienkursrenditen, das Risikofaktoren verwendet. Insofern es dabei fehlende Risikofaktoren, fehlspezifizierte Risikofaktoren oder Risikofaktoren gibt, die nicht vorhersehbar sind, ist der VaR möglicherweise kein Indikator für das künftige Risiko. Ferner sind die auf verschiedene Risikofaktoren zurückzuführenden Renditen nicht direkt am Markt beobachtbar und müssen anhand statistischer Techniken geschätzt werden. Insofern diese Schätzungen nicht genau sein können, ist der VaR möglicherweise kein Indikator für das künftige Risiko. Darüber hinaus wird die Kovarianz zwischen den Risikofaktoren über einen bestimmten historischen Zeitraum geschätzt. Insofern sich der künftige Zeitraum vom historischen Zeitraum unterscheidet, ist der VaR möglicherweise kein Indikator für das künftige Risiko. Aus diesen Gründen kann der VaR eher als relativer Risikomaßstab unter Portfolios und nicht als absoluter Risikomaßstab nützlich sein.

Für die Portfolios, die das VaR-Modell anwenden, werden mehrere Berechnungsstandards angewandt. Auf diese Berechnungsstandards wird jedoch im Risikomanagementprozess des Portfolios näher eingegangen, und sie können sich von Zeit zu Zeit im Ermessen des Managers und gemäß den Anforderungen der Zentralbank ändern.

In der nachfolgenden Tabelle ist die maximale, minimale und durchschnittliche Ausnutzung der regulatorischen VaR-Grenze für die jeweiligen Portfolios, die den VaR-Ansatz anwenden, für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 aufgeführt:

| Portfolio | Marktrisiko | Am 31. Dezember 2023 beobachteter VaR | Maximale Ausnutzung der regulatorischen VaR-Grenze* | Minimale Ausnutzung der regulatorischen VaR-Grenze* | Durchschnittliche Ausnutzung der regulatorischen VaR-Grenze* |
|---|---------------|---------------------------------------|---|---|--|
| China Bond | Absoluter VaR | 1,09 % | 9,0 % | 5,5 % | 7,8 % |
| Commodities | Relativer VaR | 99,3 % | 58,5 % | 47,8 % | 52,8 % |
| Emerging Market Debt - Hard Currency | Relativer VaR | 113,4 % | 65,3 % | 56,6 % | 60,7 % |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Relativer VaR | 111,7 % | 59,3 % | 52,1 % | 57,0 % |
| Emerging Market Debt Blend | Relativer VaR | 114,3 % | 60,6 % | 53,0 % | 57,5 % |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | Relativer VaR | 100,9 % | 78,4 % | 47,9 % | 51,9 % |
| Euro Bond | Relativer VaR | 89,0 % | 57,9 % | 44,5 % | 52,9 % |
| Euro Bond Absolute Return | Absoluter VaR | 1,77 % | 13,2 % | 7,9 % | 11,7 % |
| Event Driven | Absoluter VaR | 5,00 % | 41,9 % | 17,4 % | 26,1 % |
| Global Bond | Relativer VaR | 102,0 % | 56,0 % | 49,1 % | 51,5 % |
| Global Flexible Credit Income | Absoluter VaR | 3,14 % | 27,3 % | 14,9 % | 19,0 % |
| Global Opportunistic Bond | Absoluter VaR | 4,00 % | 24,5 % | 18,7 % | 21,4 % |
| Macro Opportunities FX | Absoluter VaR | 4,08 % | 34,3 % | 5,7 % | 15,3 % |
| Responsible Asian Debt - Hard Currency | Relativer VaR | 105,4 % | 63,4 % | 50,0 % | 57,4 % |
| Strategic Income | Absoluter VaR | 3,07 % | 24,8 % | 15,3 % | 20,8 % |
| Sustainable Asia High Yield | Relativer VaR | 82,5 % | 58,2 % | 40,5 % | 52,4 % |
| Sustainable Emerging Market Corporate Debt | Relativer VaR | 106,2 % | 58,2 % | 53,1 % | 56,0 % |
| Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency | Relativer VaR | 107,6 % | 60,1 % | 53,1 % | 57,0 % |

Anhang III (Fortsetzung)

INFORMATIONEN ÜBER DAS GESAMTRISIKO (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

| Portfolio (Fortsetzung) | Marktrisiko | Am 31. Dezember 2023 beobachteter VaR | Maximale Ausnutzung der regulatorischen VaR-Grenze* | Minimale Ausnutzung der regulatorischen VaR-Grenze* | Durchschnittliche Ausnutzung der regulatorischen VaR-Grenze* |
|----------------------------|---------------|--|---|--|---|
| Tactical Macro | Absoluter VaR | 0,64 % | 20,6 % | 1,7 % | 7,6 % |
| Ultra Short Term Euro Bond | Absoluter VaR | 0,81 % | 11,0 % | 4,1 % | 7,7 % |
| Uncorrelated Strategies | Absoluter VaR | 1,04 % | 33,2 % | 4,7 % | 12,9 % |
| US Equity Index PutWrite | Absoluter VaR | 5,75 % | 71,5 % | 12,8 % | 32,7 % |
| US Long Short Equity | Absoluter VaR | 5,28 % | 32,1 % | 21,3 % | 25,6 % |

Regulatorische VaR-Grenze für 1M 99% VAR ist 20 %. Für den relativen VaR ist 2* der Benchmark-VaR.

Die Portfolios können in Abhängigkeit von den Marktbedingungen von Zeit zu Zeit Leverage einsetzen. Das „Leverage“ wird gemäß den Anforderungen der Zentralbank als Summe der Nennwerte der eingesetzten Derivate berechnet. Das offen gelegte Leverage-Niveau ist nicht als zusätzliches Risiko-Limit für die Portfolios vorgesehen. Auch soll das Leverage-Niveau an sich keinen Hinweis auf das Risikoprofil der Portfolios darstellen. In der nachfolgenden Tabelle ist das während des Geschäftsjahres vorhandene Leverage-Niveau für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 aufgeführt, berechnet als die Summe des absoluten Wertes der Nennwerte der eingesetzten Derivate und angegeben als Prozentsatz vom Nettoinventarwert:

| Portfolio | 31. Dezember 2023 |
|---|-------------------|
| China Bond | 183 % |
| Commodities | 200 % |
| Emerging Market Debt - Hard Currency | 267 % |
| Emerging Market Debt - Local Currency | 296 % |
| Emerging Market Debt Blend | 255 % |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | 353 % |
| Euro Bond | 153 % |
| Euro Bond Absolute Return | 205 % |
| Event Driven | 266 % |
| Global Bond | 426 % |
| Global Flexible Credit Income | 230 % |
| Global Opportunistic Bond | 939 % |
| Macro Opportunities FX | 12.164 % |
| Responsible Asian Debt - Hard Currency | 155 % |
| Strategic Income | 193 % |
| Sustainable Asia High Yield | 107 % |
| Sustainable Emerging Market Corporate Debt | 126 % |
| Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency | 400 % |
| Tactical Macro | 302 % |
| Ultra Short Term Euro Bond | 137 % |
| Uncorrelated Strategies | 685 % |
| US Equity Index PutWrite | 145 % |
| US Long Short Equity | 164 % |

Anhang IV

VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (UNGEPRÜFT)

Die Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften („SFTR“) führt Berichtspflichten für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFTs“) und Total Return Swaps ein.

Ein Wertpapierfinanzierungsgeschäft (SFT) wird gemäß Artikel 3(11) der SFTR definiert als:

- ein Pensionsgeschäft/umgekehrtes Pensionsgeschäft
- Wertpapier- oder Rohstoffentleih- oder ausleihgeschäfte
- eine Kauf- und Rückkauftransaktion oder Verkaufs- und Rückkauftransaktion oder
- ein Lombardgeschäft

Zum 31. Dezember 2023 hielten die folgenden Portfolios Total Return Swaps als unter den Geltungsbereich der SFTR fallenden Instrumententyp:

CLO Income
Commodities
European High Yield Bond
Event Driven
Global Flexible Credit Income
High Yield Bond
Strategic Income
Uncorrelated Strategies
US Long Short Equity

CLO Income

Allgemeine Daten:

Vermögenswerte von Total Return Swaps beliefen sich zum 31. Dezember 2023 auf:

| Art von Vermögenswert | Betrag US\$ | Anteil am NIW (in %) |
|-------------------------------------|-------------|----------------------|
| Total Return Swaps – Vermögenswerte | 48.732 | 0,03 |

Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

Anhang IV (Fortsetzung)

VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

CLO Income (Fortsetzung)

Konzentrierte Daten:

Zum 31. Dezember 2023 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die Total Return Swaps erhalten.

Die Gegenparteien von allen Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 waren wie folgt:

| Gegenpartei | Betrag US\$ |
|-----------------------------|-------------|
| Goldman Sachs International | 48.732 |

Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2023 wurden keine Sicherheiten von der Verwahrstelle entgegengenommen oder gehalten.

Konsolidierte Transaktionsdaten:

Zum 31. Dezember 2023 gab es keine Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die in Bezug auf alle Total Return Swaps gestellt oder erhalten wurden.

Die Laufzeiten der Positionen in Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 lagen zwischen 1 Monat und 3 Monaten.

Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2023 wurden keine Sicherheiten auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten.

Ertrag/Kosten:

Bei Total Return Swaps sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Swap-Kontrakten während der Berichtsperiode identifiziert.

Anhang IV (Fortsetzung)

VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

Commodities

Allgemeine Daten:

Vermögenswerte von Total Return Swaps beliefen sich zum 31. Dezember 2023 auf:

| Art von Vermögenswert | Betrag US\$ | Anteil am NIW (in %) |
|--|-------------|----------------------|
| Total Return Swaps – Vermögenswerte | 0 | 0,00 |
| Total Return Swaps – Verbindlichkeiten | 0 | 0,00 |

Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

Konzentrierte Daten:

Zum 31. Dezember 2023 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die Total Return Swaps erhalten.

Die Gegenparteien von allen Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 waren wie folgt:

| Gegenpartei | Betrag US\$ |
|-----------------------------|-------------|
| Goldman Sachs International | 0 |

Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2023 werden alle erhaltenen Sicherheiten bei der Verwahrstelle, Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited, verwahrt.

Anhang IV (Fortsetzung)

VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

Commodities (Fortsetzung)

Konsolidierte Transaktionsdaten:

Die konsolidierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die für alle Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 gestellt oder erhalten wurden, stellten sich wie folgt dar:

| | Art der Sicherheit | Betrag US\$* | Qualität** | Laufzeit (Sicherheiten)*** | Währung von Sicherheiten | Gründungsland der Gegenpartei**** | Abwicklung und Clearing |
|-----------------------------|--------------------|--------------|------------|----------------------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------|
| Total Return Swaps | | | | | | | |
| Goldman Sachs International | Barsicherheiten | 7.330.000 | k.A. | k.A. | USD | Großbritannien | OTC |

* Barsicherheiten können eine Kombination aus Swap-Instrumenten umfassen, da ein Teil der Sicherheiten sich auf nicht unter den Geltungsbereich der SFTR fallende Swap-Vereinbarungen bezieht.

** Für Baranlagen oder Verbindlichkeiten gibt es kein Kreditrating. Aufgrund ihrer höchst liquiden Natur gelten auf US-Dollar lautende Barmittel als von höchster Qualität.

*** Aufgeteilt in 7 Fälligkeitssegmente (< 1 Tag, 1 Tag bis zu 1 Woche, 1 Woche bis zu 1 Monat, 1 Monat bis zu 3 Monaten, 3 Monate bis zu 1 Jahr, > 1 Jahr, offene Laufzeit). Barsicherheiten haben keine Laufzeit.

**** Das Land entspricht der Adresse der aktuellen Gegenpartei.

Die Laufzeiten der Positionen in Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 lagen zwischen 1 Monat und 3 Monaten.

Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Der Anteil der Sicherheiten, die zum 31. Dezember 2023 auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten wurden, war wie folgt:

| | % |
|------------------|-------|
| Getrennte Konten | 0 % |
| Gepoolte Konten | 0 % |
| Sonstiges | 100 % |
| | 100 % |

Ertrag/Kosten:

Bei Total Return Swaps sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Swap-Kontrakten während der Berichtsperiode identifiziert.

Anhang IV (Fortsetzung)

VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

European High Yield Bond

Allgemeine Daten:

Vermögenswerte von Total Return Swaps beliefen sich zum 31. Dezember 2023 auf:

| Art von Vermögenswert | Betrag US\$ | Anteil am NIW (in %) |
|-------------------------------------|-------------|----------------------|
| Total Return Swaps – Vermögenswerte | 18.355 | 0,01 |

Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

Konzentrierte Daten:

Zum 31. Dezember 2023 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die Total Return Swaps erhalten.

Die Gegenparteien von allen Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 waren wie folgt:

| Gegenpartei | Betrag US\$ |
|-----------------------------|-------------|
| Goldman Sachs International | 18.355 |

Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2023 wurden keine Sicherheiten von der Verwahrstelle entgegengenommen oder gehalten.

Konsolidierte Transaktionsdaten:

Zum 31. Dezember 2023 gab es keine Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die in Bezug auf alle Total Return Swaps gestellt oder erhalten wurden.

Die Laufzeiten der Positionen in Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 lagen zwischen 1 Monat und 3 Monaten.

Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2023 wurden keine Sicherheiten auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten.

Anhang IV (Fortsetzung)

VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

European High Yield Bond (Fortsetzung)

Ertrag/Kosten:

Bei Total Return Swaps sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Swap-Kontrakten während der Berichtsperiode identifiziert.

Event Driven

Allgemeine Daten:

Vermögenswerte von Total Return Swaps beliefen sich zum 31. Dezember 2023 auf:

| Art von Vermögenswert | Betrag US\$ | Anteil am NIW (in %) |
|-------------------------------------|-------------|----------------------|
| Total Return Swaps – Vermögenswerte | 959.529 | 0,76 |

Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

Konzentrierte Daten:

Zum 31. Dezember 2023 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die Total Return Swaps erhalten.

Die Gegenparteien von allen Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 waren wie folgt:

| Gegenpartei | Betrag US\$ |
|----------------|-------------|
| Morgan Stanley | 959.529 |

Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2023 wurden keine Sicherheiten von der Verwahrstelle entgegengenommen oder gehalten.

Konsolidierte Transaktionsdaten:

Zum 31. Dezember 2023 gab es keine Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die in Bezug auf alle Total Return Swaps gestellt oder erhalten wurden.

Die Laufzeiten der Positionen in Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 lagen zwischen 3 Monaten und 1 Jahr.

Anhang IV (Fortsetzung)

VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

Event Driven (Fortsetzung)

Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2023 wurden keine Sicherheiten auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten.

Ertrag/Kosten:

Bei Total Return Swaps sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Swap-Kontrakten während der Berichtsperiode identifiziert.

Global Flexible Credit Income

Allgemeine Daten:

Vermögenswerte von Total Return Swaps beliefen sich zum 31. Dezember 2023 auf:

| Art von Vermögenswert | Betrag US\$ | Anteil am NIW (in %) |
|-------------------------------------|-------------|----------------------|
| Total Return Swaps – Vermögenswerte | 268.263 | 0,07 |

Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

Konzentrierte Daten:

Zum 31. Dezember 2023 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die Total Return Swaps erhalten.

Die Gegenparteien von allen Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 waren wie folgt:

| Gegenpartei | Betrag US\$ |
|---------------------|-------------|
| JPMorgan Chase Bank | 268.263 |

Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2023 werden alle erhaltenen Sicherheiten bei der Verwahrstelle, Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited, verwahrt.

Anhang IV (Fortsetzung)

VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

Global Flexible Credit Income (Fortsetzung)

Konsolidierte Transaktionsdaten:

Die konsolidierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die für alle Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 gestellt oder erhalten wurden, stellten sich wie folgt dar:

| | Art der Sicherheit | Betrag US\$* | Qualität** | Laufzeit (Sicherheiten)*** | Währung von Sicherheiten | Gründungsland der Gegenpartei**** | Abwicklung und Clearing |
|---------------------------|--------------------|--------------|------------|----------------------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------|
| Total Return Swaps | | | | | | | |
| JPMorgan Chase Bank | Barsicherheiten | (200.000) | k.A. | k.A. | USD | USA | OTC |

* Barsicherheiten können eine Kombination aus Swap-Instrumenten umfassen, da ein Teil der Sicherheiten sich auf nicht unter den Geltungsbereich der SFTR fallende Swap-Vereinbarungen bezieht.

** Für Baranlagen oder Verbindlichkeiten gibt es kein Kreditrating. Aufgrund ihrer höchst liquiden Natur gelten auf US-Dollar lautende Barmittel als von höchster Qualität.

*** Aufgeteilt in 7 Fälligkeitssegmente (< 1 Tag, 1 Tag bis zu 1 Woche, 1 Woche bis zu 1 Monat, 1 Monat bis zu 3 Monaten, 3 Monate bis zu 1 Jahr, > 1 Jahr, offene Laufzeit). Barsicherheiten haben keine Laufzeit.

**** Das Land entspricht der Adresse der aktuellen Gegenpartei.

Die Laufzeiten der Positionen in Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 lagen zwischen 1 Monat und 3 Monaten.

Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2023 wurden keine Sicherheiten auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten.

Ertrag/Kosten:

Bei Total Return Swaps sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Swap-Kontrakten während der Berichtsperiode identifiziert.

Anhang IV (Fortsetzung)

VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond

Allgemeine Daten:

Vermögenswerte von Total Return Swaps beliefen sich zum 31. Dezember 2023 auf:

| Art von Vermögenswert | Betrag US\$ | Anteil am NIW (in %) |
|--|-------------|----------------------|
| Total Return Swaps – Verbindlichkeiten | 51.928 | 0,00 |

Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

Konzentrierte Daten:

Zum 31. Dezember 2023 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die Total Return Swaps erhalten.

Die Gegenparteien von allen Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 waren wie folgt:

| Gegenpartei | Betrag US\$ |
|---------------------|-------------|
| JPMorgan Chase Bank | 51.928 |

Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2023 wurden keine Sicherheiten von der Verwahrstelle entgegengenommen oder gehalten.

Konsolidierte Transaktionsdaten:

Zum 31. Dezember 2023 gab es keine Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die in Bezug auf alle Total Return Swaps gestellt oder erhalten wurden.

Die Laufzeiten der Positionen in Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 lagen zwischen 1 Monat und 3 Monaten.

Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2023 wurden keine Sicherheiten auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten.

Ertrag/Kosten:

Bei Total Return Swaps sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Swap-Kontrakten während der Berichtsperiode identifiziert.

Anhang IV (Fortsetzung)

VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

Strategic Income

Allgemeine Daten:

Vermögenswerte von Total Return Swaps beliefen sich zum 31. Dezember 2023 auf:

| Art von Vermögenswert | Betrag US\$ | Anteil am NIW (in %) |
|-------------------------------------|-------------|----------------------|
| Total Return Swaps – Vermögenswerte | 461.585 | 0,02 |

Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

Konzentrierte Daten:

Zum 31. Dezember 2023 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die Total Return Swaps erhalten.

Die Gegenparteien von allen Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 waren wie folgt:

| Gegenpartei | Betrag US\$ |
|-----------------------------|-------------|
| Goldman Sachs International | 461.585 |

Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2023 werden alle erhaltenen Sicherheiten bei der Verwahrstelle, Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited, verwahrt.

Konsolidierte Transaktionsdaten:

Die konsolidierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die für alle Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 gestellt oder erhalten wurden, stellten sich wie folgt dar:

| | Art der Sicherheit | Betrag US\$* | Qualität** | Laufzeit (Sicherheiten)*** | Währung von Sicherheiten | Gründungsland der Gegenpartei**** | Abwicklung und Clearing | |
|---------------------------|-----------------------------|-----------------|------------|----------------------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------|-----|
| Total Return Swaps | | | | | | | | |
| | Goldman Sachs International | Barsicherheiten | (520.000) | k.A. | k.A. | USD | Großbritannien | OTC |

* Barsicherheiten können eine Kombination aus Swap-Instrumenten umfassen, da ein Teil der Sicherheiten sich auf nicht unter den Geltungsbereich der SFTR fallende Swap-Vereinbarungen bezieht.

** Für Baranlagen oder Verbindlichkeiten gibt es kein Kreditrating. Aufgrund ihrer höchst liquiden Natur gelten auf US-Dollar lautende Barmittel als von höchster Qualität.

*** Aufgeteilt in 7 Fälligkeitssegmente (< 1 Tag, 1 Tag bis zu 1 Woche, 1 Woche bis zu 1 Monat, 1 Monat bis zu 3 Monaten, 3 Monate bis zu 1 Jahr, > 1 Jahr, offene Laufzeit). Barsicherheiten haben keine Laufzeit.

**** Das Land entspricht der Adresse der aktuellen Gegenpartei.

Anhang IV (Fortsetzung)

VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

Strategic Income (Fortsetzung)

Konsolidierte Transaktionsdaten (Fortsetzung):

Die Laufzeiten der Positionen in Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 lagen zwischen 1 Monat und 3 Monaten.

Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2023 wurden keine Sicherheiten auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten.

Ertrag/Kosten:

Bei Total Return Swaps sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Swap-Kontrakten während der Berichtsperiode identifiziert.

Uncorrelated Strategies

Allgemeine Daten:

Vermögenswerte von Total Return Swaps beliefen sich zum 31. Dezember 2023 auf:

| Art von Vermögenswert | Betrag US\$ | Anteil am NIW (in %) |
|--|-------------|----------------------|
| Total Return Swaps – Vermögenswerte | 3.395.463 | 0,21 |
| Total Return Swaps – Verbindlichkeiten | 3.021.166 | 0,20 |

Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

Anhang IV (Fortsetzung)

VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

Konzentrierte Daten:

Zum 31. Dezember 2023 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die Total Return Swaps erhalten.

Die Gegenparteien von allen Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 waren wie folgt:

| Gegenpartei | Betrag US\$ |
|-----------------------------|-------------|
| Goldman Sachs International | 617.852 |
| JPMorgan Chase Bank | 443.988 |
| Morgan Stanley | 2.861.379 |
| Société Générale | 2.229.122 |
| UBS AG | 264.288 |

Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2023 wurden keine Sicherheiten von der Verwahrstelle entgegengenommen oder gehalten.

Konsolidierte Transaktionsdaten:

Die konsolidierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die für alle Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 gestellt oder erhalten wurden, stellten sich wie folgt dar:

| | Art der Sicherheit | Betrag US\$* | Qualität** | Laufzeit (Sicherheiten)*** | Währung von Sicherheiten | Gründungsland der Gegenpartei**** | Abwicklung und Clearing |
|---|--------------------|--------------|------------|----------------------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------|
| Total Return Swaps | | | | | | | |
| Citibank | Barsicherheiten | 17.000.000 | k.A. | k.A. | USD | Großbritannien | OTC |
| BNP Paribas | Barsicherheiten | 47.910.000 | k.A. | k.A. | USD | USA | OTC |
| Bank of America Merrill Lynch International | Barsicherheiten | 7.270.000 | k.A. | k.A. | USD | USA | OTC |
| Morgan Stanley | Barsicherheiten | 4.230.000 | k.A. | k.A. | USD | USA | OTC |
| Nomura International PLC | Barsicherheiten | 46.360.000 | k.A. | k.A. | USD | USA | OTC |

Anhang IV (Fortsetzung)

VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

Konsolidierte Transaktionsdaten (Fortsetzung):

| | Art der Sicherheit | Betrag US\$* | Qualität** | Laufzeit (Sicherheiten)*** | Währung von Sicherheiten | Gründungsland der Gegenpartei**** | Abwicklung und Clearing |
|-------------------------------------|--------------------|--------------|------------|-------------------------------|-----------------------------|--------------------------------------|----------------------------|
| Total Return Swaps (Fortsetzung) | | | | | | | |
| Société Générale | Barsicherheiten | 63.000.000 | k.A. | k.A. | USD | Frankreich | OTC |
| UBS AG London | Barsicherheiten | 8.250.000 | k.A. | k.A. | USD | Großbritannien | OTC |

* Barsicherheiten können eine Kombination aus Swap-Instrumenten umfassen, da ein Teil der Sicherheiten sich auf nicht unter den Geltungsbereich der SFTR fallende Swap-Vereinbarungen bezieht.

** Für Baranlagen oder Verbindlichkeiten gibt es kein Kreditrating. Aufgrund ihrer höchst liquiden Natur gelten auf US-Dollar lautende Barmittel als von höchster Qualität.

*** Aufgeteilt in 7 Fälligkeitssegmente (< 1 Tag, 1 Tag bis zu 1 Woche, 1 Woche bis zu 1 Monat, 1 Monat bis zu 3 Monaten, 3 Monate bis zu 1 Jahr, > 1 Jahr, offene Laufzeit). Barsicherheiten haben keine Laufzeit.

**** Das Land entspricht der Adresse der aktuellen Gegenpartei.

Die Laufzeiten von Positionen in Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 stellten sich wie folgt dar:

| Fälligkeit | Betrag US\$ | | | | | | offene Laufzeit |
|--|-------------|----------------------|---------------------------|--------------------------|------------------------|----------|-----------------|
| | < 1 Tag | 1 Tag bis zu 1 Woche | 1 Woche bis zu 1 Monat | 1 Monat bis zu 3 Monaten | 3 Monate bis zu 1 Jahr | > 1 Jahr | |
| Total Return Swaps - Vermögenswerte | - | - | - | 2.549.664 | 327.396 | 518.403 | - |
| Total Return Swaps - Verbindlichkeiten | - | - | - | 370.564 | 2.567.730 | 82.872 | - |

Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Der Anteil der Sicherheiten, die zum 31. Dezember 2023 auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten wurden, war wie folgt:

| | % |
|------------------|--------------|
| Getrennte Konten | 0 % |
| Gepoolte Konten | 0 % |
| Sonstiges | 100 % |
| | 100 % |

Anhang IV (Fortsetzung)

VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

Ertrag/Kosten:

Bei Total Return Swaps sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Swap-Kontrakten während der Berichtsperiode identifiziert.

US Long Short Equity

Allgemeine Daten:

Vermögenswerte von Total Return Swaps beliefen sich zum 31. Dezember 2023 auf:

| Art von Vermögenswert | Betrag US\$ | Anteil am NIW (in %) |
|--|-------------|----------------------|
| Total Return Swaps – Verbindlichkeiten | 4.635.993 | 2,36 |

Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

Konzentrierte Daten:

Zum 31. Dezember 2023 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die Total Return Swaps erhalten.

Die Gegenparteien von allen Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 waren wie folgt:

| Gegenpartei | Betrag US\$ |
|-----------------------------|-------------|
| Goldman Sachs International | 2.434.032 |
| JPMorgan Chase Bank | 2.201.961 |

Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2023 werden alle erhaltenen Sicherheiten bei der Verwahrstelle, Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited, verwahrt.

Anhang IV (Fortsetzung)

VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

US Long Short Equity (Fortsetzung)

Konsolidierte Transaktionsdaten:

Die konsolidierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die für alle Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 gestellt oder erhalten wurden, stellten sich wie folgt dar:

| | Art der Sicherheit | Betrag US\$* | Qualität** | Laufzeit (Sicherheiten)*** | Währung von Sicherheiten | Gründungsland der Gegenpartei**** | Abwicklung und Clearing |
|-----------------------------|--------------------|--------------|------------|-------------------------------|-----------------------------|--------------------------------------|----------------------------|
| Total Return Swaps | | | | | | | |
| Goldman Sachs International | Barsicherheiten | 7.530.000 | k.A. | k.A. | USD | Großbritannien | OTC |
| JP Morgan Chase Bank | Barsicherheiten | 7.620.000 | k.A. | k.A. | USD | USA | OTC |

* Barsicherheiten können eine Kombination aus Swap-Instrumenten umfassen, da ein Teil der Sicherheiten sich auf nicht unter den Geltungsbereich der SFTR fallende Swap-Vereinbarungen bezieht.

** Für Baranlagen oder Verbindlichkeiten gibt es kein Kreditrating. Aufgrund ihrer höchst liquiden Natur gelten auf US-Dollar lautende Barmittel als von höchster Qualität.

*** Aufgeteilt in 7 Fälligkeitssegmente (< 1 Tag, 1 Tag bis zu 1 Woche, 1 Woche bis zu 1 Monat, 1 Monat bis zu 3 Monaten, 3 Monate bis zu 1 Jahr, > 1 Jahr, offene Laufzeit). Barsicherheiten haben keine Laufzeit.

**** Das Land entspricht der Adresse der aktuellen Gegenpartei.

Die Laufzeiten von Positionen in Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 stellten sich wie folgt dar:

| Fälligkeit | Betrag US\$ | | | | | | offene Laufzeit |
|--|-------------|----------------------|---------------------------|--------------------------|------------------------|----------|-----------------|
| | < 1 Tag | 1 Tag bis zu 1 Woche | 1 Woche bis zu 1 Monat | 1 Monat bis zu 3 Monaten | 3 Monate bis zu 1 Jahr | > 1 Jahr | |
| Total Return Swaps - Verbindlichkeiten | - | - | - | 2.348.409 | 2.102.134 | 185.450 | - |

Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Der Anteil der Sicherheiten, die zum 31. Dezember 2023 auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten wurden, war wie folgt:

| | % |
|------------------|-------|
| Getrennte Konten | 0 % |
| Gepoolte Konten | 0 % |
| Sonstiges | 100 % |
| | 100 % |

Anhang IV (Fortsetzung)

VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

US Long Short Equity (Fortsetzung)

Ertrag/Kosten:

Bei Total Return Swaps sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Swap-Kontrakten während der Berichtsperiode identifiziert.

Zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 war keines der Portfolios an Wertpapierleihgeschäften beteiligt.

Anhang V

ANGABEN ZUR VERGÜTUNG (UNGEPRÜFT)

Die Richtlinie der Europäischen Union 2014/91/EU (die „OGAW-V Richtlinie“) trat am 18. März 2016 in Kraft. Der Fonds hat eine Vergütungspolitik eingeführt, um den Anforderungen der OGAW-V-Richtlinie und der ESMA-Leitlinien für solide Vergütungspolitiken gemäß der OGAW-V-Richtlinie in einer Form und in dem Umfang zu entsprechen, wie es der Größe des Fonds, seiner internen Organisation und der Art, dem Gegenstand und der Komplexität seiner Aktivitäten angemessen ist.

Die Vergütungspolitik des Fonds gilt für identifizierte Mitarbeiter, deren berufliche Tätigkeiten einen wesentlichen Einfluss auf das Risikoprofil des Fonds haben.

Zum 31. Dezember 2023 hatte der Fonds keine Mitarbeiter, und die Vergütungspolitik des Fonds gilt nur für Mitglieder des Direktoriums des Fonds, die den Fonds verwalten und kontrollieren. Nähere Angaben zu den Honoraren der Direktoren finden sich in Anmerkung 7.

Die Direktoren ernannten NBAMIL zum Manager, um die laufenden Geschäfte des Fonds zu führen. NBAMIL hat eine Vergütungspolitik im Einklang mit der OGAW-V-Richtlinie angenommen. Nähere Angaben zu den in den zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 von NBAMIL vereinnahmten Gebühren finden sich in Anmerkung 10.

Anhang VI

GLOSSAR DER INDIZES (UNGEPRÜFT)

Bloomberg Commodity Index

Der Index ist ein rollierender Index, der sich aus börsengehandelten Futures-Kontrakten auf physische Rohstoffe zusammensetzt. Der Index verlässt sich bei der Bestimmung der relativen Mengen der aufgenommenen Rohstoffe vor allem auf Liquiditätsdaten von Futureskontrakten sowie auf USD-bereinigte Produktionsdaten. Der Index soll eine hoch liquide und diversifizierte Benchmark für Rohstoffanlagen sein. Die Indexversion, die auf Basis der Gesamrendite berechnet wird, spiegelt die Renditen auf eine voll besicherte Anlage in den zugrunde liegenden Rohstoff-Futureskontrakten wider, kombiniert mit den Renditen auf in US Treasury Bills investierten Barsicherheiten.

Bloomberg Euro Aggregate Bond Index (Total Return, abgesichert, EUR)

Der Index umfasst festverzinsliche, in Euro denominierte Anleihen mit Investment-Grade-Rating. Die Aufnahme basiert auf der Währung der Emission und nicht auf dem Domizilland des Emittenten. Die wichtigsten Sektoren des Index sind Staatsanleihen, Unternehmensanleihen, regierungsnahen Anleihen und verbriefte Emissionen.

Bloomberg Global Aggregate Corporate Index (Total Return, Hedged, USD)

Bei dem Index handelt es sich um ein führendes Maß für globale festverzinsliche Unternehmensanleihen mit Investment-Grade-Rating. Diese mehrere Währungen enthaltende Benchmark umfasst Anleihen von Emittenten der Sektoren Industrie, Versorgung und Finanzwesen aus Industrie- und Schwellenländern. Der Index ist Bestandteil der Global Aggregate and Multiverse Indizes.

Bloomberg Global Aggregate Index (Total Return, abgesichert, USD)

Der Index misst globale Schuldtitel mit Investment Grade von vierundzwanzig verschiedenen lokalen Währungsmärkten und umfasst festverzinsliche Treasuries, regierungsnahen Titel sowie Unternehmens- und verbriefte Anleihen von Emittenten aus Industrie- und Schwellenländern. Der Index besteht im Wesentlichen aus drei wichtigen regionalen Aggregatkomponenten: dem Bloomberg US Aggregate Bond Index, dem Bloomberg Pan-European Aggregate Bond Index und dem Bloomberg Asian-Pacific Aggregate Index. Neben Wertpapieren aus diesen drei Indizes enthält der Index zudem Papiere mit Investment Grade (Eurodollar, Euro-Yen, kanadische) und für den Index geeignete 144A Wertpapiere, die nicht bereits in diesen drei Indizes enthalten sind. Der Index ist voll in USD abgesichert.

Bloomberg Global Aggregate Index (Total Return, nicht abgesichert, USD)

Der Index misst globale Schuldtitel mit Investment Grade von vierundzwanzig verschiedenen lokalen Währungsmärkten und umfasst festverzinsliche Treasuries, regierungsnahen Titel sowie Unternehmens- und verbriefte Anleihen von Emittenten aus Industrie- und Schwellenländern. Der Index besteht im Wesentlichen aus drei wichtigen regionalen Aggregatkomponenten: dem Bloomberg US Aggregate Bond Index, dem Bloomberg Pan-European Aggregate Bond Index und dem Bloomberg Asian-Pacific Aggregate Index. Neben Wertpapieren aus diesen drei Indizes enthält der Index zudem Papiere mit Investment Grade (Eurodollar, Euro-Yen, kanadische) und für den Index geeignete 144A Wertpapiere, die nicht bereits in diesen drei Indizes enthalten sind.

Bloomberg US Aggregate Bond Index (Total Return, USD)

Der Index misst den in US-Dollar denominierten, festverzinslichen, steuerpflichtigen Markt für Anleihen mit Investment Grade und umfasst Treasuries, regierungsnahen Titel und Unternehmensanleihen, Mortgage Backed Securities (Agency Fixed Rate und Hybrid Variable Rate Mortgage Pass-Throughs), forderungsbesicherte Anleihen (Asset-Backed Securities sowie Commercial Mortgage-Backed Securities (Agency und Non-Agency)). Der Index ist eine breit angelegte Benchmark, die den in US-Dollar denominierten, festverzinslichen, steuerpflichtigen Markt für Anleihen mit Investment Grade misst. Dazu gehören Treasuries, regierungsnahen Titel und Unternehmensanleihen, hypothekarisch besicherte Anleihen (MBS), forderungsbesicherte Anleihen (ABS) sowie besicherte MBS.

Anhang VI (Fortsetzung)

GLOSSAR DER INDIZES (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

Cboe S&P 500 PutWrite Index

Der Index bildet den Wert einer passiven Anlagestrategie ab, die aus einem Overlay von S&P 500 (SPX) Short-Verkaufsoptionen über ein in ein- und dreimonatige Schatzwechsel investiertes Geldmarktkonto besteht. Die SPX-Verkaufsoptionen werden At-The-Money ausgeführt und monatlich verkauft.

Cboe S&P 500 One-Week PutWrite Index

Der Index bildet die Wertentwicklung einer hypothetischen Strategie ab, die wöchentlich eine At-the-Money (ATM) S&P 500 Index (SPX)-Verkaufsoption verkauft. Die Fälligkeit der geschriebenen SPX-Verkaufsoption ist eine Woche vor Verfall. Die geschriebene SPX-Verkaufsoption wird über ein in einmonatige Schatzwechsel investiertes Geldmarktkonto besichert. Der Index wird wöchentlich aktualisiert, üblicherweise jeden Freitag.

FTSE Chinese Government and Policy Bank Bond 0-1 Year Select Index (Total Return, CNY)

Der Index misst die Wertentwicklung von auf CNY lautenden, festverzinslichen Staatsanleihen in stückloser Form sowie von Policy Bank Bonds, die auf dem chinesischen Festland ausgegeben wurden. Die folgenden Instrumente sind ausgeschlossen: Sparbriefe, spezielle Staatsanleihen, Zentralbankwechsel, Privatplatzierungen und abrufbare und kündbare Anleihen.

FTSE EPRA Nareit Developed Real Estate Index (Total Return, Net of Tax, USD)

Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der die Wertentwicklung von börsennotierten Immobiliengesellschaften und Real Estate Investment Trusts (REITs) in Industrieländern messen soll. Netto-Gesamtertragsindizes reinvestieren Dividenden nach Abzug der Quellensteuern unter Verwendung eines Steuersatzes (für internationale Indizes), der für gebietsfremde institutionelle Anleger gilt, die nicht von Doppelbesteuerungsabkommen profitieren.

FTSE Nareit All Equity REITs Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD)

Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der die Wertentwicklung von an der New York Stock Exchange oder der NASDAQ notierten steuerbegünstigten Immobiliengesellschaften (REITs) abbildet. Eigenkapital-REITs umfassen alle steuerbegünstigten REITs mit mehr als 50 Prozent des Gesamtvermögens an qualifizierten Immobilienanlagen mit Ausnahme von grundpfandrechtlich gesicherten Hypotheken.

HFRX Equity Hedge Index (Total Return, USD)

Der Index soll Aktien-Hedgefondsstrategien repräsentieren, die überwiegend Long- und Short-Positionen in Aktien und Aktien-Derivaten halten. Aktien-Hedge-Manager würden in der Regel mindestens 50 % und können in manchen Fällen im Wesentlichen vollständig in Long- als auch Short-Aktienpositionen investiert sein.

ICE BofA European Currency Non-Financial High Yield 3% Constrained Index (Total Return, EUR)

Der Index misst die Wertentwicklung von in Euro und GBP denominierten Unternehmensanleihen unterhalb von Investment Grade von Nichtfinanzunternehmen, die am Eurobondmarkt und Sterling- oder Euro-Inlandsmärkten öffentlich begeben werden. Das Engagement in einem Emittenten ist auf 3 % begrenzt. Der Index enthält alle nicht finanziellen Wertpapiere des ICE BofA European Currency High Yield Index, begrenzt aber das Engagement bei individuellen Emittenten auf 3 %.

ICE BofA Global High Yield Constrained Index (Total Return, Hedged, USD)

Der Index bildet die Wertentwicklung von in USD, CAD, GBP und EUR denominierten Unternehmensanleihen unterhalb Investment Grade ab, die an den wichtigsten Inlands- oder Eurobondmärkten öffentlich begeben werden. Das Engagement in jedem der im Index enthaltenen Emittenten ist auf maximal 2 % des Index begrenzt. Der Index enthält alle Wertpapiere des ICE BofA Global High Yield Index, begrenzt aber das Emittentenrisiko auf 2 %.

ICE BofA Global Hybrid Non-Financial 5% Constrained Custom Index (Total Return, Hedged, Euro)

Der Index bildet die Wertentwicklung von nicht finanziellen hybriden Unternehmensanleihen mit Investment Grade ab, die öffentlich an wichtigen Inlands- und Eurobond-Märkten begeben werden, wobei die Gewichtung jedes Emittenten auf maximal 5 % begrenzt ist.

ICE BofA US Dollar 1-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return, USD)

Der Index ist eine weit verbreitete Benchmark für kurzfristige Zinssätze. Er gibt einen Hinweis auf die Durchschnittskurse, zu denen Banken für bestimmte Zeiträume in bestimmten Währungen ungesicherte Interbankkredite aufnehmen können.

Anhang VI (Fortsetzung)

GLOSSAR DER INDIZES (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return, USD)

Der Index bildet die Wertentwicklung eines synthetischen Vermögenswerts ab, der bis zu einer angegebenen Fälligkeit den SOFR-Satz zahlt. Der Index basiert auf dem angenommenen Kauf eines synthetischen Instruments mit genau derselben angegebenen Fälligkeit und einem Kupon in Höhe des an diesem Tag geltenden Fixingkurses. Es wird davon ausgegangen, dass diese Emission am folgenden Werktag verkauft (mit einer Rendite in Höhe des an diesem Tag geltenden Fixingkurses) und in ein neues Instrument umgewandelt wird.

ICE BofA US High Yield Constrained Index (Total Return, USD)

Der Index bildet die Wertentwicklung von in US-Dollar denominierten Unternehmensanleihen ohne Investment Grade ab, die öffentlich auf dem US-Inlandmarkt begeben werden. Neben der Erfüllung anderer Kriterien müssen zulässige Wertpapiere ein Rating unterhalb von Investment Grade aufweisen (basierend auf dem Durchschnitt der Ratings von Moody's, S&P und Fitch) und Risiken gegenüber G10 FX-Ländern, Westeuropa oder Gebieten der USA und Westeuropas ausgesetzt sein. Wertpapiere, die rechtlich in Verzug sind, werden vom Index ausgeschlossen. Indexkomponenten sind kapitalisierungsgewichtet, sofern die Gesamtallokation bei einem einzelnen Emittenten 2 % nicht überschreitet.

ICE BofA 0-1 Year AAA Euro Government Index (Total Return, EUR)

Der Index ist eine Teilmenge des ICE BofA All Maturity Euro Government Index einschließlich aller Wertpapiere mit einer Fälligkeit von weniger als 1 Jahr und einem Rating von AAA. Der Index bildet die Wertentwicklung von in EUR denominierten Staatsanleihen ab, die von den Euro-Mitgliedsländern öffentlich entweder auf dem Eurobondmarkt oder dem Heimatmarkt des Emittenten begeben werden. Die zulässigen Länder müssen Euro-Mitglieder sein, über ein Investment Grade Rating für langfristige Staatsschulden in Fremdwährung verfügen (basierend auf dem Durchschnitt von Moody's, S&P und Fitch) und über mindestens eine leicht zugängliche, transparente Preisquelle für ihre Wertpapiere verfügen. Um für die Aufnahme in Betracht gezogen zu werden, muss ein Land zum ersten eines Monats Euro-Mitglied sein.

ICE BofA 3-Month US Treasury Bill Index (Total Return, USD)

Der Index besteht aus einer einzelnen US Treasury Bill-Emission, die zu Beginn eines jeden Monats gekauft und einen ganzen Monat lang gehalten wird. Zum Monatsende wird diese Emission verkauft und durch eine neu ausgewählte Emission ersetzt, die am nächsten zu drei Monaten ab dem Datum des Neuausrichtung, aber nicht darüber hinaus, fällig wird.

JP Morgan Asia Credit Index (JACI) (Total Return, USD)

Der Index bildet die Gesamtertragsperformance für aktiv gehandelte, in US-Dollar denominierte Schuldtitel in der Region Asien (ohne Japan) ab. JACI ist ein marktkapitalgewichteter Index, der Staatsanleihen, quasistaatliche und Unternehmensanleihen umfasst und nach Ländern, Sektoren und Kreditrating unterteilt ist.

JP Morgan ESG Asia Credit High Yield Index (Total Return, USD) (JESG JACI)

Der Index bildet die Gesamtertragsperformance für aktiv gehandelte, in US-Dollar denominierte Schuldtitel in der Region Asien (ohne Japan) ohne Investment Grade ab, die bestimmte ESG-Kriterien erfüllen.

JP Morgan Corporate Emerging Markets Bond Index (CEMBI)-Diversified Index (Total Return, USD)

Der Index bildet die Wertentwicklung von in US-Dollar denominierten Unternehmensanleihen aus Schwellenländern ab, darunter Schwellenländer aus Asien, Europa, Lateinamerika und dem Nahen Osten/Afrika. Die diversifizierte Version des Index ist marktkapitalisierungsgewichtet und begrenzt die Gewichtungen der Indexländer mit größeren Unternehmensschuldtiteln, indem sie nur bestimmte Teile der zulässigen aktuellen Beträge der ausstehenden Schuldtitel dieser Länder berücksichtigt. Mit Wirkung vom 31. März 2022 wurden Russland und Weißrussland aus den JP Morgan Fixed Income Indizes ausgeschlossen. Der Marktwert des Index für alle russischen und weißrussischen Schuldtitel wurde auf null festgesetzt, was einen Verlust der gesamten Rendite aufgrund der Marktstörung reflektiert.

Anhang VI (Fortsetzung)

GLOSSAR DER INDIZES (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

JP Morgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (Total Return, USD)

Der Index bildet die Wertentwicklung von in US-Dollar denominierten Schuldtiteln staatlicher und quasistaatlicher Emittenten aus Schwellenländern (Brady-Anleihen, Kredite und Euroanleihen) ab, darunter Schwellenländer aus Asien, Europa, Lateinamerika und dem Nahen Osten/Afrika. Die globale Version des Index erfasst ein breites, umfassendes Universum von Emissionen aus Schwellenländern. Die diversifizierte Version des Index ist marktkapitalisierungsgewichtet und begrenzt die Gewichtungen der Indexländer mit größeren Schuldtiteln, indem sie nur bestimmte Teile der zulässigen aktuellen Beträge der ausstehenden Schuldtitel dieser Länder berücksichtigt. Mit Wirkung vom 31. März 2022 wurden Russland und Weißrussland aus den JP Morgan Fixed Income Indizes ausgeschlossen. Der Marktwert des Index für alle russischen und weißrussischen Schuldtitel wurde auf null festgesetzt, was einen Verlust der gesamten Rendite aufgrund der Marktstörung reflektiert.

JP Morgan ESG CEMBI Broad Diversified (Total Return, USD)

Der Index bildet in US-Dollar denominierte fest- und variabel verzinsliche Schuldtitel aus Schwellenländern ab, die von Unternehmen emittiert werden. Der Index wendet eine ESG-Scoring- und Screening-Methode an, um einerseits Emittenten, die laut ESG-Kriterien höher eingestuft sind, sowie grünen Anleihen den Vorzug zu geben und andererseits Emittenten, die niedriger eingestuft sind, unterzugewichten und zu entfernen.

JP Morgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified Index (Total Return, USD)

Der Index bildet die Wertentwicklung von liquiden, in US-Dollar denominierten fest- und variabel verzinslichen Schuldtiteln staatlicher und quasistaatlicher Emittenten aus Schwellenländern (Brady-Anleihen, Darlehen und Eurobonds) ab, die eine Restlaufzeit von mindestens 2,5 Jahren haben. Der Index wendet eine ESG-Scoring- und Screening-Methode an, um einerseits Emittenten, die laut ESG-Kriterien höher eingestuft sind, sowie grünen Anleihen den Vorzug zu geben und andererseits Emittenten, die niedriger eingestuft sind, unterzugewichten und zu entfernen.

JP Morgan Government Bond Index (GBI)-Emerging Markets Global Diversified (Total Return, nicht währungsgesichert, USD)

Der Index bildet die Wertentwicklung von Anleihen in lokaler Währung ab, die von Regierungen der Schwellenländer ausgegeben wurden, einschließlich Schwellenländern aus Asien, Europa, Lateinamerika und dem Nahen Osten/Afrika. Die globale Version des Index enthält nur Länder, die für den Großteil der internationalen Anleger zugänglich sind. Länder mit expliziten Kapitalkontrollen sind ausgeschlossen. Die diversifizierte Version des Index ist nach Marktkapitalisierung gewichtet. Die Höchstgewichtung pro Land beträgt 10 %. Mit Wirkung vom 31. März 2022 wurden Russland und Weißrussland aus den JP Morgan Fixed Income Indizes ausgeschlossen. Der Marktwert des Index für alle russischen und weißrussischen Schuldtitel wurde auf null festgesetzt, was einen Verlust der gesamten Rendite aufgrund der Marktstörung reflektiert.

MSCI All Country World Index (ACWI) (Total Return, abzüglich Steuern, USD)

Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, kapitalisierungsgewichteter Index, der die Aktienmarktperformance von Industrie- und Schwellenländern messen soll. Der Index besteht aus 47 Länderindizes, die 23 Industrie- und 24 Schwellenländerindizes umfassen. Die enthaltenen Indizes aus Industrieländern sind: Australien, Österreich, Belgien, Kanada, Dänemark, Finnland, Frankreich, Deutschland, Hongkong, Irland, Israel, Italien, Japan, die Niederlande, Neuseeland, Norwegen, Portugal, Singapur, Spanien, Schweden, die Schweiz, das Vereinigte Königreich und die USA. Die enthaltenen Schwellenländerindizes sind: Brasilien, Chile, China, Kolumbien, Tschechien, Ägypten, Griechenland, Ungarn, Indien, Indonesien, Korea, Kuwait, Malaysia, Mexiko, Peru, die Philippinen, Polen, Katar, Saudi-Arabien, Südafrika, Taiwan, Thailand, die Türkei und die VAE. Chinesische A-Aktien werden seit dem 1. Juni 2018 aufgenommen und sind seit November 2019 teilweise mit 20 % ihrer um den Streubesitz bereinigten Marktkapitalisierung vertreten. Netto-Gesamtertragsindizes reinvestieren Dividenden nach Abzug der Quellensteuern unter Verwendung eines Steuersatzes (für internationale Indizes), der für gebietsfremde institutionelle Anleger gilt, die nicht von Doppelbesteuerungsabkommen profitieren. Mit Wirkung nach Börsenschluss am 9. März 2022 stuft MSCI den Status des MSCI Russia Index um, und zwar von Emerging Markets auf den Status eines eigenständigen Marktes. Zu diesem Zeitpunkt wurden alle russischen Wertpapiere zu einem Endpreis von 0,00001 aus diesem Index entfernt, einschließlich lokal gehandelter russischer Aktien und der russischen ADRs/GDRs.

Anhang VI (Fortsetzung)

GLOSSAR DER INDIZES (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

MSCI All Country World (ACWI) Value Index (Total Return, Net of Tax, USD)

Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, kapitalisierungsgewichteter Index, der die Wertentwicklung von Large- und Mid-Cap-Aktien mit, im Großen und Ganzen, Value-Merkmalen aus 23 entwickelten Märkten und 24 Schwellenmärkten repräsentiert. Die Merkmale des Value-Anlagestils für diesen Index werden anhand von drei Variablen definiert: Verhältnis zwischen Kurs und Buchwert (KBV), Verhältnis zwischen Kurs und Gewinn (KGV) basierend auf Prognosen für die nächsten zwölf Monate und Dividendenrendite.

MSCI China A Onshore Index (Total Return, CNY)

Bei dem Index handelt es sich um einen kapitalisierungsgewichteten Index, dessen Komponentenzahl variieren kann und der so konzipiert ist, dass er die Wertentwicklung der breiten Volkswirtschaft der VRC anhand von Veränderungen des Gesamtmarktwerts der größten Aktien misst, die alle maßgeblichen Branchen repräsentieren.

MSCI China All Shares Index (Total Return, USD)

Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, nach Marktkapitalisierung gewichteter Index, der die Aktienmarktperformance chinesischer Anteilklassen messen soll, die in Hongkong, Shanghai, Shenzhen und außerhalb Chinas notiert sind. Er deckt das integrierte Aktienuniversum des MSCI China ab, das A-Aktien, B-Aktien, H-Aktien, Red Chips, P-Chips und ausländische Notierungen außerhalb Chinas oder Hongkongs (z. B. ADRs) umfasst. A-Aktien sind Aktien von in China gegründeten Unternehmen und werden an den Börsen von Shanghai und Shenzhen gehandelt. Sie notieren in Renminbi und unterliegen den Vorschriften für ausländische Investitionen (QFII). B-Aktien sind Aktien von in China gegründeten Unternehmen und werden an den Börsen von Shanghai und Shenzhen gehandelt. Sie notieren Fremdwährungen (Shanghai USD, Shenzhen HKD) und sind für ausländische Anleger zugänglich. H-Aktien sind Aktien von in China gegründeten Unternehmen und werden an der Börse in Hongkong und anderen ausländischen Börsen gehandelt. Red Chips und P-Chips sind Papiere von Unternehmen, die außerhalb Chinas gegründet werden und an der Börse in Hongkong handeln. Red Chips werden in der Regel vom Staat oder einer Provinz oder Gemeinde kontrolliert. P-Chips sind nicht staatliche chinesische Unternehmen, die außerhalb des Festlandes gegründet wurden und in Hongkong gehandelt werden. Netto-Gesamtertragsindizes reinvestieren Dividenden nach Abzug der Quellensteuern unter Verwendung eines Steuersatzes (für internationale Indizes), der für gebietsfremde institutionelle Anleger gilt, die nicht von Doppelbesteuerungsabkommen profitieren.

MSCI Emerging Markets Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD)

Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der die Aktienmarktperformance von Schwellenländern messen soll. Der Index besteht aus den folgenden 24 Schwellenländerindizes: Brasilien, Chile, China, Kolumbien, Tschechien, Ägypten, Griechenland, Ungarn, Indien, Indonesien, Korea, Kuwait, Malaysia, Mexiko, Peru, die Philippinen, Polen, Katar, Saudi-Arabien, Südafrika, Taiwan, Thailand, die Türkei und die VAE. Chinesische A-Aktien werden seit dem 1. Juni 2018 aufgenommen und sind seit November 2019 teilweise mit 20 % ihrer um den Streubesitz bereinigten Marktkapitalisierung vertreten. Mit Wirkung nach Börsenschluss am 9. März 2022 stuft MSCI den Status des MSCI Russia Index um, und zwar von Emerging Markets auf den Status eines eigenständigen Marktes. Zu diesem Zeitpunkt wurden alle russischen Wertpapiere zu einem Endpreis von 0,00001 aus diesem Index entfernt, einschließlich lokal gehandelter russischer Aktien und der russischen ADRs/GDRs. Netto-Gesamtertragsindizes reinvestieren Dividenden nach Abzug der Quellensteuern unter Verwendung eines Steuersatzes (für internationale Indizes), der für gebietsfremde institutionelle Anleger gilt, die nicht von Doppelbesteuerungsabkommen profitieren.

MSCI Europe Index (Total Return, abzüglich Steuern, EUR)

Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der die Aktienmarktperformance von entwickelten Märkten in Europa messen soll.

Anhang VI (Fortsetzung)

GLOSSAR DER INDIZES (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

| | |
|--|--|
| MSCI Japan Small Cap Net Index (Total Return, JPY) | Der Index soll die Wertentwicklung des Small-Cap-Segments des japanischen Marktes messen. |
| MSCI World Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) | Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der die Aktienmarktperformance von entwickelten Märkten messen soll. |
| Russell 1000 Value Index (Total Return, Net of Tax, USD) | Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der die Wertentwicklung des Large-Cap-Value-Segments des US-Aktienmarktes misst. Dazu gehören die Unternehmen im Russell 1000 Index, die ein niedrigeres KBV und niedrigere prognostizierte Wachstumsraten aufweisen. Der Index wird jedes Jahr im Juni neu ausgerichtet. |
| Russell 2000 Index (Total Return, Net of Tax, USD) | Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der die Wertentwicklung des Small-Cap-Segments des US-Aktienmarktes misst. Er enthält etwa 2.000 der kleinsten Wertpapiere im Russell 3000 Index (der die Performance der 3.000 größten US-amerikanischen Aktiengesellschaften anhand der gesamten Marktkapitalisierung misst). Der Index wird jedes Jahr im Juni neu ausgerichtet. |
| Russell 2000 Value Index (Total Return, Net of Tax, USD) | Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der die Wertentwicklung des Small-Cap-Value-Segments des US-Aktienmarktes misst. Dazu gehören die Unternehmen im Russell 2000 Index, die ein niedrigeres KBV und niedrigere prognostizierte Wachstumsraten aufweisen. Der Index wird jedes Jahr im Juni neu ausgerichtet. |
| S&P 500 Index (Total Return, Net of Tax, USD) | Der Index ist um den Streubesitz bereinigt und marktkapitalisierungsgewichtet, mit Schwerpunkt auf dem Large-Cap-Segment des US-Aktienmarktes. Er umfasst einen wesentlichen Anteil des Gesamtwerts des Marktes. |
| Gewichteter Durchschnitt aus 2/3 JP Morgan EMBI Global Diversified Investment Grade Index (Total Return, USD) und 1/3 JP Morgan GBI EM Global Diversified Index Investment Grade 15% Cap Index (Total Return, nicht währungsgesichert, USD) | Der kombinierte Index setzt sich zu 2/3 aus dem JP Morgan EMBI Global Diversified Investment Grade Index (Total return, USD) (wie zuvor beschrieben) und zu 1/3 aus dem JP Morgan GBI-EM Global Diversified Index Investment Grade 15% Cap Index (Total return, USD, nicht währungsgesichert) (wie zuvor beschrieben) zusammen und wird monatlich neu ausgerichtet. |
| 50% JP Morgan GBI Emerging Markets Global Diversified Index (Total Return, nicht währungsgesichert, USD), 25% JP Morgan EMBI Global Diversified Index (Total Return, USD) und 25% JP Morgan CEMBI Diversified Index (Total Return, USD) | Der kombinierte Index setzt sich zu 50% aus dem JP Morgan GBI Emerging Markets Global Diversified, zu 25% aus dem JP Morgan EMBI Global Diversified und zu 25% aus dem JP Morgan CEMBI Diversified (alle zuvor beschrieben) zusammen und wird monatlich neu ausgerichtet. Mit Wirkung vom 31. März 2022 wurden Russland und Weißrussland aus den JP Morgan Fixed Income Indizes ausgeschlossen. Der Marktwert des Index für alle russischen und weißrussischen Schuldtitel wurde auf null festgesetzt, was einen Verlust der gesamten Rendite aufgrund der Marktstörung reflektiert. |
| 50% Cboe S&P 500 One-Week PutWrite Index / 50% Cboe S&P 500 PutWrite Index | Der kombinierte Index setzt sich zu 50 % aus dem Cboe S&P 500 One-Week PutWrite Index (wie zuvor beschrieben) und zu 50 % aus dem Cboe S&P 500 PutWrite Index (wie zuvor beschrieben) zusammen. |

Anhang VII

MANAGER, SUB-INVESTMENT-MANAGER UND UNTERBERATER (UNGEPRÜFT)

Nähere Angaben zu den Managern, Sub-Investment-Managern und Unterberatern sind in der nachstehenden Tabelle aufgeführt.

| Fondsname | Manager | Sub-Investment-Manager | Unterberater (verbunden) | Unterberater (nicht verbunden) |
|---|--|---|---|--|
| 5G Connectivity | Neuberger Berman Asset Management Ireland Limited („NBAMIL“) | Neuberger Berman Investment Advisers LLC („NBIA“) Neuberger Berman Asia Limited („NBAL“) | | |
| China A-Share Equity | NBAMIL | NBIA NBAL | | |
| China Bond | NBAMIL | NBIA Neuberger Berman Singapore Pte. Limited („NBS“) NBAL | Neuberger Berman Fund Management (China) Limited („NB China“) | |
| China Equity | NBAMIL | | | Green Court Capital Management Limited („Green Court“) |
| Klimainnovation | NBAMIL | NBIA NBEL | | |
| CLO Income | NBAMIL | NBIA | | |
| Commodities | NBAMIL | NBIA NBEL | | |
| Corporate Hybrid Bond | NBAMIL | NBIA NBS | | |
| Developed Market FMP – 2027 | NBAMIL | NBIA NBEL | | |
| Emerging Market Debt – Hard Currency | NBAMIL | NBIA NBS | | |
| Emerging Market Debt – Local Currency | NBAMIL | NBIA NBS | NB China | |
| Emerging Market Debt Blend | NBAMIL | NBIA NBS | NB China | |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | NBAMIL | NBIA NBS | | |
| Emerging Markets Equity | NBAMIL | NBIA NBAL | | |
| Euro Bond | NBAMIL | | | |
| Euro Bond Absolute Return | NBAMIL | | | |

Anhang VII (Fortsetzung)

MANAGER, SUB-INVESTMENT-MANAGER UND UNTERBERATER (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

| Fondsname | Manager | Sub-Investment-Manager | Unterberater (verbunden) | Unterberater (nicht verbunden) |
|--------------------------------------|---------|--|--------------------------|--------------------------------|
| European High Yield Bond | NBAMIL | NBIA | | |
| European Sustainable Equity | NBAMIL | NBIA | | |
| Event Driven | NBAMIL | NBEL | | |
| | | NBIA | | |
| Global Bond | NBAMIL | NBIA | | |
| | | NBS | | |
| Global Diversified Income FMP – 2024 | NBAMIL | NBIA | | |
| | | NBS | | |
| Global Equity Megatrends | NBAMIL | NBIA | | |
| Global Flexible Credit Income | NBAMIL | NBIA | | |
| | | NBS | | |
| Global High Yield SDG Engagement | NBAMIL | NBIA | | |
| | | NBS | | |
| Global Investment Grade Credit | NBAMIL | NBEL | | |
| | | NBIA | | |
| Global Opportunistic Bond | NBAMIL | NBIA | | |
| | | NBS | | |
| Global Real Estate Securities | NBAMIL | NBIA | | |
| | | NBAL | | |
| Global Sustainable Equity | NBAMIL | NBIA | | |
| Global Sustainable Value | NBAMIL | NBIA | | |
| | | Neuberger Berman Canada ULC („NB Canada“) | | |
| High Yield Bond | NBAMIL | NBIA | | |
| InnovAsia 5G | NBAMIL | NBEL | | |
| | | NBIA | | |
| | | NBAL | | |
| Japan Equity Engagement | NBAMIL | Neuberger Berman East Asia Limited („NBEAL“) | | |
| Macro Opportunities FX | NBAMIL | NBIA | | |
| Next Generation Mobility | NBAMIL | NBIA | | |
| | | NBAL | | |

Anhang VII (Fortsetzung)

MANAGER, SUB-INVESTMENT-MANAGER UND UNTERBERATER (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

| Fondsname | Manager | Sub-Investment-Manager | Unterberater (verbunden) | Unterberater (nicht verbunden) |
|--|---------|------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|
| Next Generation Space Economy | NBAMIL | NBEL | | |
| | | NBIA | | |
| Responsible Asian Debt – Hard Currency | NBAMIL | NBIA | | |
| | | NBS | | |
| Short Duration Emerging Market Debt | NBAMIL | NBIA | | |
| | | NBS | | |
| Short Duration High Yield SDG Engagement | NBAMIL | NBIA | | |
| Strategic Income | NBAMIL | NBIA | | |
| | | NBS | | |
| Sustainable Asia High Yield | NBAMIL | NBEL | | |
| | | NBIA | | |
| | | NBS | | |
| Sustainable Emerging Market Corporate Debt | NBAMIL | NBIA | | |
| | | NBS | | |
| Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency | NBAMIL | NBEL | | |
| | | NBIA | | |
| | | NBS | | |
| Tactical Macro | NBAMIL | NBIA | | |
| | | NBEL | | |
| Ultra Short Term Euro Bond | NBAMIL | NBEL | | |
| Uncorrelated Strategies | NBAMIL | NBIA | NB Alternatives Advisers LLC („NBAA“) | AltIQ LLP |
| | | | | BH-DG Systematic Trading LLP |
| | | | | P/E Global LLC |
| | | | | True Partner Capital USA Holding Inc |
| | | | | Cipher Capital LP |
| | | | | G10 Capital Limited |
| | | | | Crabel Capital Management, LLC |
| | | | | AllianceBernstein L.P. |
| | | | | Portman Square Capital LLP |
| | | | | Soloda Investment Advisors LLP |

Anhang VII (Fortsetzung)

MANAGER, SUB-INVESTMENT-MANAGER UND UNTERBERATER (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

| Fondsname | Manager | Sub-Investment-Manager | Unterberater (verbunden) | Unterberater (nicht verbunden) |
|------------------------------|---------|------------------------|--------------------------|--------------------------------|
| US Equity | NBAMIL | NBIA | | |
| US Equity Index PutWrite | NBAMIL | NBIA | | |
| US Large Cap Value | NBAMIL | NBEL | | |
| | | NBIA | | |
| US Long Short Equity | NBAMIL | NBIA | | |
| US Multi Cap Opportunities | NBAMIL | NBIA | | |
| US Real Estate Securities | NBAMIL | NBIA | | |
| US Small Cap | NBAMIL | NBIA | | |
| US Small Cap Intrinsic Value | NBAMIL | NBIA | | |

Anhang VIII

OFFENLEGUNGSVERORDNUNG (UNGEPRÜFT)

Die folgenden Portfolios wurden als Artikel-6-Portfolio für die Zwecke der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rats vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor („SFDR“) kategorisiert: Neuberger Berman CLO Income Fund (CLO Bond Portfolio), Neuberger Berman US Equity Index Putwrite Fund, Neuberger Berman Macro Opportunities FX Fund, Neuberger Berman Tactical Macro Fund (Liquid Alternatives Portfolios), Neuberger Berman US Small Cap Intrinsic Value Fund (US Equity Portfolios), Neuberger Berman China Equity Fund (China Portfolios), Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund, Neuberger Berman Uncorrelated Trading Fund (Multi Strategy Portfolios), Neuberger Berman Commodities Fund (Quantitative and Multi Asset Portfolios) und Neuberger Berman Event Driven Fund (Global Equity Portfolios).

Für die Zwecke der Taxonomie-Verordnung wird darauf hingewiesen, dass die Anlagen in zugrunde liegenden Artikel-6-Portfolios den EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten nicht Rechnung tragen.

Die folgenden Portfolios wurden als Artikel-8-Portfolios für die Zwecke der SFDR klassifiziert: Neuberger Berman High Yield Bond Fund, Neuberger Berman Short Duration High Yield SDG Engagement Fund, Neuberger Berman European High Yield Bond Fund, Neuberger Berman Global High Yield SDG Engagement Fund, Neuberger Berman Global High Yield Sustainable Action Fund (High Yield Bond Portfolios), Neuberger Berman Emerging Market Debt – Local Currency Fund, Neuberger Berman Emerging Market Debt – Hard Currency Fund, Neuberger Berman Sustainable Emerging Market Corporate Debt Fund, Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund, Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund, Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Fund, Neuberger Berman Responsible Asian Debt – Hard Currency Fund, Neuberger Berman Sustainable Asia High Yield Fund (Emerging Market Debt Portfolios), Neuberger Berman China Bond Fund (China Bond Portfolios), Neuberger Berman Global Bond Fund, Neuberger Berman Strategic Income Fund, Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund, Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund, Neuberger Berman Global Flexible Credit Income Fund, Neuberger Berman Global Investment Grade Credit Fund (Fixed Income Portfolios), Neuberger Berman Global Diversified Income FMP – 2024, Neuberger Berman Developed Market FMP - 2027 (Fixed Maturity Portfolios), Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund, Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund, Neuberger Berman Euro Bond Fund (Euro Fixed Income Portfolios), Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund, Neuberger Berman Global Sustainable Value Fund (Quantitative and Multi Asset Portfolios), Neuberger Berman US Long Short Equity Fund (Liquid Alternatives Portfolios), Neuberger Berman US Equity Fund, Neuberger Berman US Small Cap Fund, Neuberger Berman US Multi Cap Opportunities Fund, Neuberger Berman US Large Cap Value Fund (US Equity Portfolios), Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund, Neuberger Berman Emerging Markets Select Equity Fund, Neuberger Berman Japan Equity Engagement Fund (Global Equity Portfolios), Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund, Neuberger Berman Global Real Estate Securities Fund (Real Estate Portfolios), Neuberger Berman China A-Share Equity Fund (China Portfolios), Neuberger Berman 5G Connectivity Fund, Neuberger Berman Global Equity Megatrends Fund, Neuberger Berman InnovAsia 5G Fund, Neuberger Berman Next Generation Mobility Fund, Neuberger Berman Metaverse Fund, Neuberger Berman Next Generation Space Economy Fund, Neuberger Berman Climate Innovation Fund (Thematic Equity Portfolios), Neuberger Berman Global Sustainable Equity Fund und Neuberger Berman European Sustainable Equity Fund (Sustainable Equity Portfolios) (die „Artikel-8-Portfolios“). Informationen zu den ökologischen und sozialen Merkmalen der Artikel-8-Fonds, mit Ausnahme der nicht aufgelegten Fonds, sind im Anhang unten verfügbar. Wir machen keine weiteren Angaben zum Neuberger Berman Metaverse Fund, da er nicht aufgelegt wurde.

Der Neuberger Berman Sustainable Emerging Market Debt – Hard Currency Fund (Emerging Market Debt Portfolios) wurde zum Zwecke der SFDR als Artikel-9-Portfolio (das „Artikel-9-Portfolio“) kategorisiert.

Im Einklang mit den Anforderungen von Artikel 11 der SFDR wurden keine Informationen in Bezug auf jedes Artikel-8-Portfolio und das Artikel-9-Portfolio in diesen Anhang aufgenommen. Sofern nicht anderweitig in diesem Anhang definiert, haben Begriffe in Großbuchstaben die ihnen in diesem Prospekt verliehene Bedeutung.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman 5G Connectivity Fund (das „Portfolio“)

Unternehmenskennung: 549300H0HOXG52ES7840

Ökologische und/oder soziale Merkmale

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

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

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

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

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

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

Nein

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 56,8 %* an nachhaltigen Investitionen

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

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

mit einem sozialen Ziel

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

*Weitere Einzelheiten zur Vermögensallokation des Portfolios (einschließlich des Engagements in nachhaltige Investitionen) finden Sie unter der Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „Bezugszeitraum“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

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?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („**THG**“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzmitteln und zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Anreize für Mitarbeiter und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsnormen in der Lieferkette, Vielfalt und Integration der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortungsvolles Marketing.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

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

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**NB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sekorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistenteam für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient- oder externes Rating aufwiesen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachten) zu erreichen.

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Bezugszeitraum | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|-----------------|-------------------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | ES: B G: 2,5 | ES: A-D G: 1-4 | 96 % |
| Daten von Dritten | 6,8 | 0-10 | |

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale („**ES**“) werden die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („**G**“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und der Chancen durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 6,1 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 96 %, was einem Durchschnitt der CVaR-Abdeckung über die vier Kalenderquartalsenden hinweg entspricht.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy und die Neuberger Berman Enhanced Sustainable Exclusion Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

| | NB-ESG-Quotient-Rating | Rating der Daten durch externe Anbieter | Kombinierte Abdeckung |
|----------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| Bereich | ES: A-D | 0-10 | 0-100% |

| | | | |
|----------------------------|-----------------|-----|-------|
| | G: 1-4 | | |
| Bezugszeitraum 2022 | ES: B G: 2,7 | 6,5 | 100 % |
| Bezugszeitraum 2023 | ES: B G: 2,5 | 6,8 | 96 % |

Das ES-Rating des NB-ESG-Quotienten ist im Vergleich zum Vorjahr unverändert geblieben.

Die Bewertung G-Ratings des NB-ESG-Quotienten hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmen und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

Das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmen und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen sowie auf potenzielle Änderungen oder Unterschiede im externen Rating des Unternehmens.

2. CVaR

| | CVaR | Abdeckung |
|----------------------------|--------|-----------|
| Bezugszeitraum 2022 | -2,6 % | 97 % |
| Bezugszeitraum 2023 | -6,1 % | 96 % |

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die CVaR-Prognose aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmen und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verändert.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

| | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|-------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0 |
| Bezugszeitraum 2023 | 0 |

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

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat, wie nachstehend erläutert, und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Unternehmens, um festzustellen, ob das Unternehmen einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Unternehmens auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Sub-Investment-Manager überprüfte die Unternehmen auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Unternehmen dieser Prüfung standhielten, quantifizierte der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag der Unternehmen zur Wirtschaft.

Der Sub-Investment-Manager erfasste dies auf zwei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDGs“).

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbaren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

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

Der Sub-Investment-Manager wandte seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigten. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „PAIs“):

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

| PAIs | |
|-------------------------------|--|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgasemissionen</i> | PAI 1- THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind PAI 5 -Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren |
| <i>Biodiversität</i> | PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken |
| <i>Wasser</i> | PAI 8 - Emissionen in Wasser |
| <i>Abfall</i> | PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle |

| | |
|-----------------------------------|--|
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | <p>PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen</p> <p>PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen</p> <p>PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle</p> <p>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen</p> <p>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)</p> |
|-----------------------------------|--|

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Sub-Investment-Manager hat auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

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

Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

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

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

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

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „*Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?*“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.
2. Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| PAIs auf Produktebene | |
|-----------------------------------|--|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgas-emissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|------------------------------------|--|-------------------------|-------------------------|
| ADVANCED DEVICES INC | MICRO C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 4 % | USA |
| NVIDIA CORP | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 4 % | USA |
| SERVICENOW INC | J – Information and Communication | 4 % | USA |
| T MOBILE US INC | J – Information und Kommunikation | 3 % | USA |
| MICROSOFT CORP | J – Information und Kommunikation | 3 % | USA |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 3 % | Taiwan (Republik China) |
| PALO ALTO NETWORKS INC | J – Information und Kommunikation | 3 % | USA |
| HUBSPOT INC | J – Information und Kommunikation | 3 % | USA |
| ARISTA NETWORKS INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 3 % | USA |
| ORACLE CORP | J – Information und Kommunikation | 3 % | USA |
| AMAZON COM INC | G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 3 % | USA |
| ASM INTERNATIONAL NV | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 3 % | Niederlande |
| DEXCOM INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2 % | USA |
| META PLATFORMS CLASS A INC | J – Information und Kommunikation | 2 % | USA |
| BROADCOM INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2 % | USA |



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

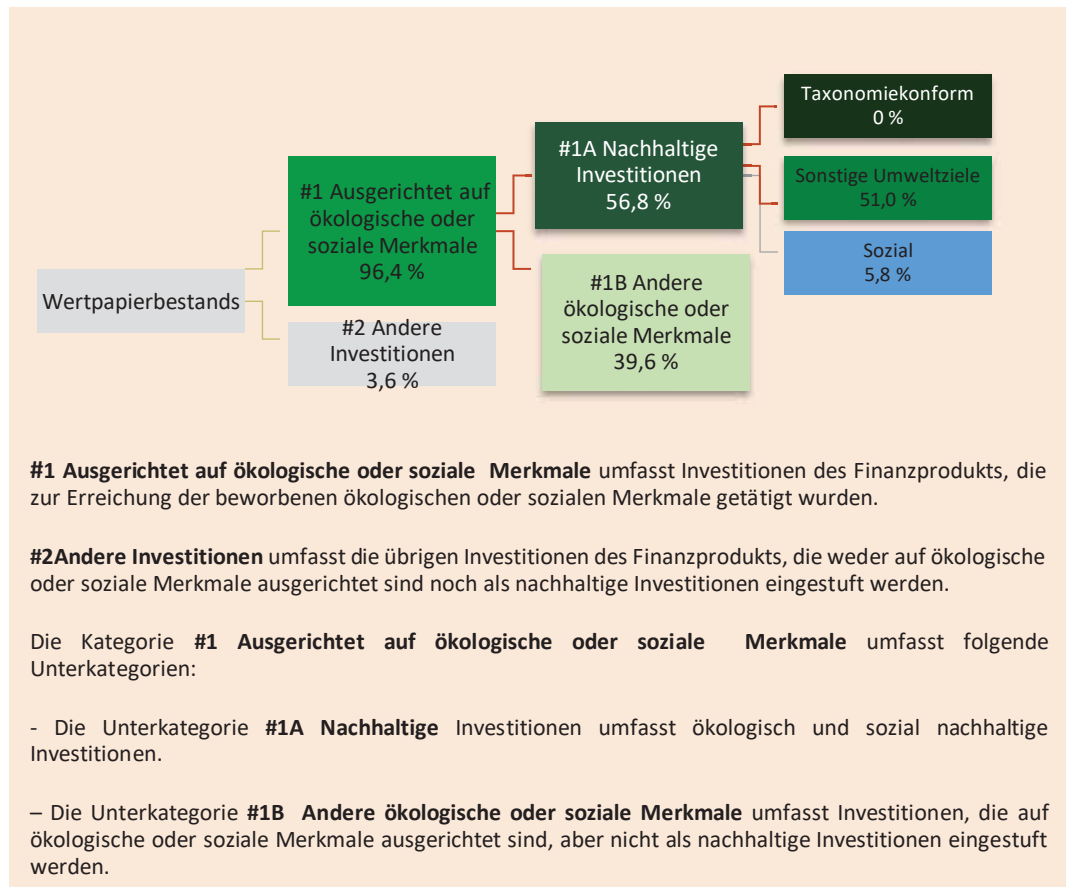
- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 96,4 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio verpflichtet sich, mindestens 10 % an nachhaltigen Investitionen zu halten. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 56,8 % an nachhaltigen Investitionen.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 3,6 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

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

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



● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|--|-------------------------|
| C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 61,1 % |
| G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 4,7 % |
| J – Information und Kommunikation | 33,2 % |
| N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 1,0 % |



Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

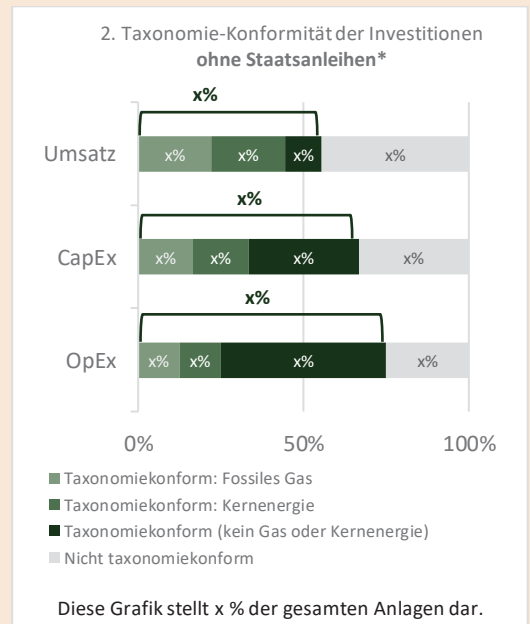
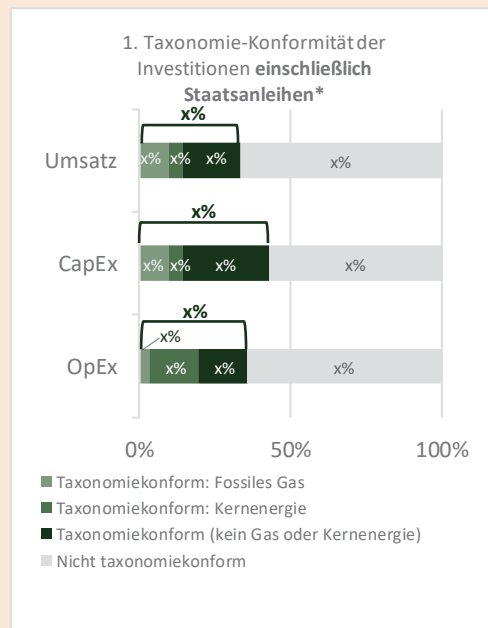
Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

- Ja:
- In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



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

¹ Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.



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

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Das Portfolio hielt 51,0 % an nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Das Portfolio hielt 5,8 % an sozial nachhaltigen Investitionen.



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

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das externe Rating oder das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung eines Unternehmens besser zu erkennen, wobei der Schwerpunkt des Portfolios auf Investitionen in Unternehmen lag, die sich an der Entwicklung und Verbesserung des mobilen Internets und der 5G-Konnektivität beteiligen.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die thematische Beurteilung und die Gesamtbeurteilung des Unternehmens bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wendete das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
k.A.

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

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman China A-Share Equity Fund (das „Portfolio“)

Unternehmenskennung: 54930037QMZTCH4D7291

Ökologische und/oder soziale Merkmale

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

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja



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

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

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

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



Nein

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

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

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

mit einem sozialen Ziel



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

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „Bezugszeitraum“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

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?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Luftqualität, Energiemanagement, Umweltpolitik, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zur Gesundheitsversorgung, Cybersicherheitssystem und -schulungen, Qualitätsmanagement, Gesundheit und Arbeitsbedingungen und Arbeitsunfälle, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement und Preistransparenz.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („NB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen werden. Der Sub-Investment-Manager griff auf die Wesentlichkeitsmatrix von NB und lokalen Erkenntnisse zum chinesischen Markt zurück, um die wesentlichen ESG-Merkmale für chinesische A-Aktien anzupassen. Im Hinblick auf chinesische A-Aktien bewertete der Sub-Investment-Manager die langfristigen ESG-Merkmale und Werttreiber der Branchen Chinas und der darin tätigen Unternehmen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Unternehmen mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Unternehmen mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Unternehmen diesbezüglich keine Maßnahmen ergreift, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühte sich der Sub-Investment-Manager, konstruktiven Dialogen bei Unternehmen mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

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

Die Methodik und die Bandbreite für den NB-ESG-Quotienten des Portfolios (mit einem speziellen Fokus auf dem chinesischen Markt) wurden während des Bezugszeitraums aktualisiert. Dies ist Teil der anhaltenden Bemühungen des Sub-Investment-Managers, die Abdeckung und Zuverlässigkeit der Daten zu verbessern.

Die nachstehend offengelegten Daten für den NB-ESG-Quotienten, die kombinierte Abdeckung und das Rating durch externe Anbieter wurden durch die Bildung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechnet.

Der aktualisierte NB-ESG-Quotient verwendet ein Rating zwischen CCC und AAA, wobei CCC das niedrigste und AAA das höchste Rating darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

| Bezugszeitraum | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | AAA | CCC-AAA | 96 % |
| Daten von Dritten | 4,2 | 0-10 | |

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und der Chancen durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 33,1 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügt. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 91 %, was einem Durchschnitt der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale entspricht.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy und die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstießen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

1. NB-ESG-Quotient

| | NB-ESG-Quotient | Daten von Dritten | Kombinierte Abdeckung |
|------------------------------------|-----------------|-------------------|-----------------------|
| Bezugszeitraum 2022 Bereich | CCC-AA | 0-10 | 0-100 % |
| Bezugszeitraum 2023 Bereich | CCC-AAA | 0-10 | 0-100 % |
| Bezugszeitraum 2022 | BBB | 4,0 | 92 % |
| Bezugszeitraum 2023 | AAA | 4,2 | 96 % |

Wie bereits erwähnt, wurden die Methodik und die Bandbreite für den NB-ESG-Quotienten des Portfolios (mit einem speziellen Fokus auf dem chinesischen Markt) während des Bezugszeitraums aktualisiert. Dies sollte bei dem Versuch berücksichtigt werden, die Daten des Bezugszeitraums mit den Daten des Bezugszeitraums 2022 zu vergleichen.

Das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei der Datenabdeckung für einzelne im Portfolio gehaltene Unternehmen, einzelne im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen sowie auf potenzielle Änderungen oder Unterschiede im externen Unternehmen-Rating.

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die kombinierte Abdeckung durch den NB-ESG-Quotienten und das Rating externer Anbieter verbessert. Dies ist eine Folge von Änderungen der Methodik des NB-ESG-Quotienten und Verbesserungen bei der Datenabdeckung für einzelne im Portfolio gehaltene Unternehmen sowie von Handelsaktivitäten.

2. CVaR

| | CVaR | Abdeckung |
|----------------------------|---------|-----------|
| Bezugszeitraum 2022 | -23,7 % | 94 % |
| Bezugszeitraum 2023 | -33,1 % | 91 % |

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich der prognostizierte CVaR-Verlust aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmen und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios erhöht. Wie bereits erwähnt, kann die Szenarioanalyse als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken dienen, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße.

| | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|-------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0 |
| Bezugszeitraum 2023 | 0 |

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

k.A.

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

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager nicht in Unternehmen investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit ihnen übereinstimmten), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

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

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

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

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „PAIs auf Produktebene“):

| PAIs auf Produktebene | |
|-----------------------------------|--|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgas-emissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|------------------------------------|--|-------------------------|-------|
| KWEICHOW MOUTAI LTD A | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 8,0 % | China |
| MIDEA GROUP LTD A | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 4,1 % | China |
| WULIANGYE YIBIN LTD A | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 3,9 % | China |
| SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECT | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 3,8 % | China |
| LUXSHARE PRECISION INDUSTRY LTD A | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 3,6 % | China |
| PING AN INSURANCE (GROUP) OF CHINA | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 3,5 % | China |
| BANK OF NINGBO LTD A | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 2,9 % | China |
| INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GRO | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,5 % | China |
| FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP LTD A | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,4 % | China |
| SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY LTD A | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,4 % | China |
| SANY HEAVY INDUSTRY LTD A | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,4 % | China |
| NARI TECHNOLOGY LTD A | J – Information und Kommunikation | 2,3 % | China |
| CHINA CONSTRUCTION BANK CORP A | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 2,2 % | China |
| TENCENT HOLDINGS LTD | J – Information und Kommunikation | 2,1 % | China |
| TSINGTAO BREWERY LTD A | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,0 % | China |



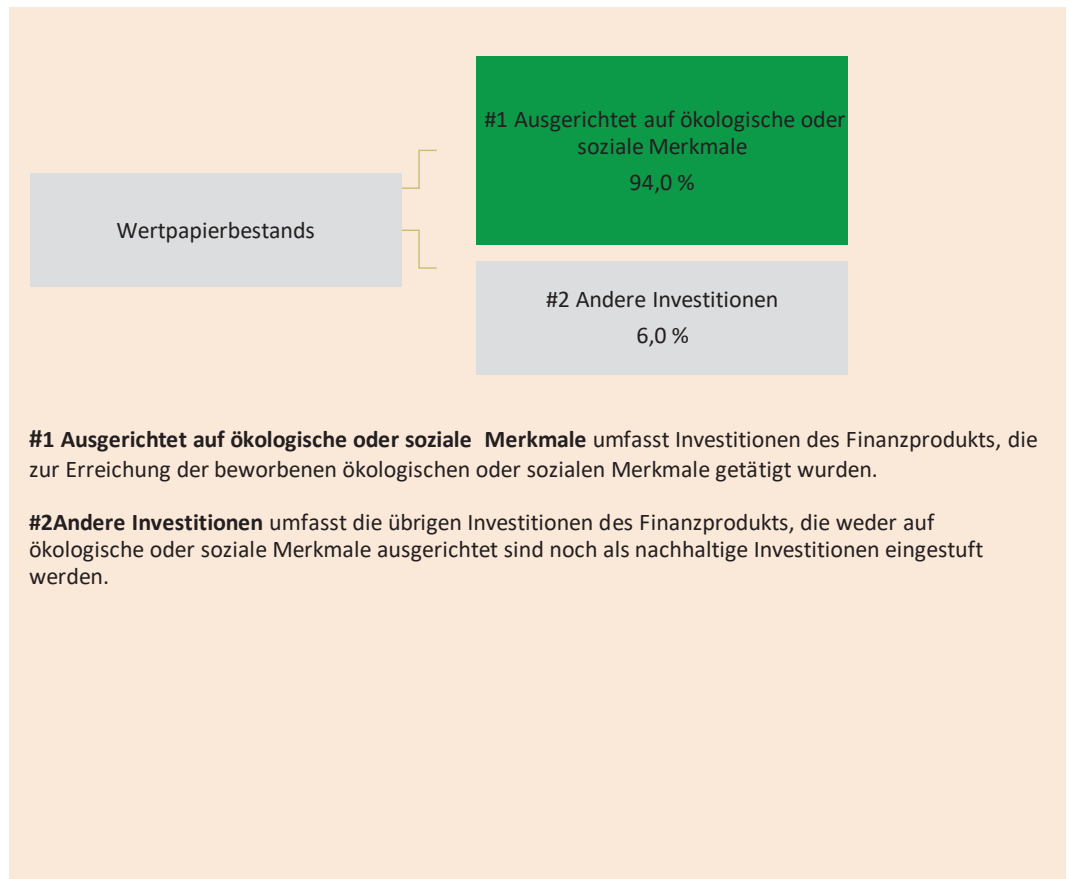
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % an Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 94,0 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 6,0 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



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

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|---|-------------------------|
| C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 67,8 % |
| D – Energieversorgung | 1,7 % |
| F – Baugewerbe/Bau | 2,8 % |
| G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 4,3 % |
| H – Verkehr und Lagerei | 0,3 % |
| J – Information und Kommunikation | 5,6 % |
| K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 14,5 % |
| M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen | 1,6 % |
| Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen | 1,5 % |

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

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

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine 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?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

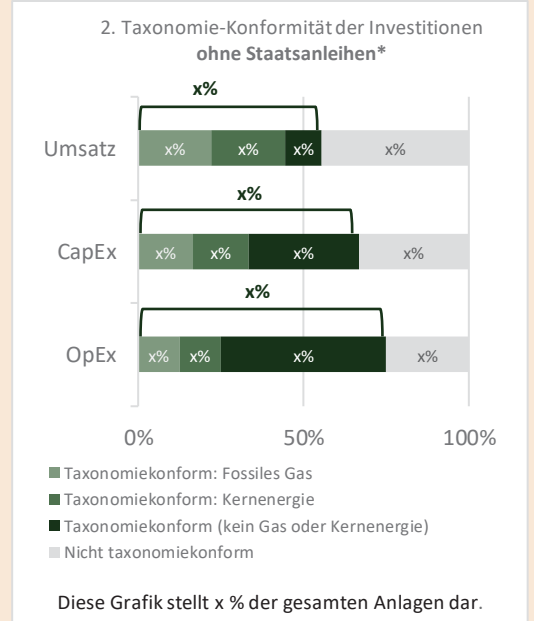
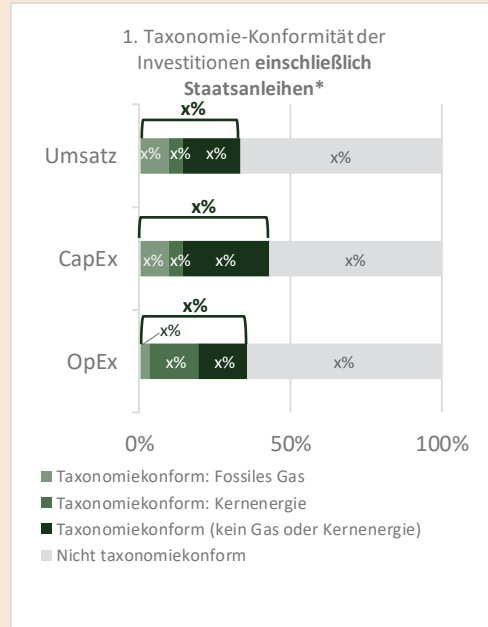
- Ja: In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

¹ Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



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

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde herangezogen, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen. Durch die Integration der hausinternen lokalen Erkenntnisse zum chinesischen Markt und der ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die Gesamtbeurteilung des Unternehmens bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses.

Um die Beziehungen zu den Unternehmen aufrechtzuerhalten und zu verbessern und sicherzustellen, dass die Unternehmen ihren ESG-Kurs verfolgten, führte der Sub-Investment-Manager mit den Unternehmen einen aktiven Dialog, unabhängig davon, ob sie Kontroversen mit großen Auswirkungen oder ein schlechtes NB ESG-Quotient-Rating aufwiesen oder nicht. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

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

k.A.

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

k.A.

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

k.A.

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

k.A.

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

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman China Bond Fund (das „Portfolio“)

Unternehmenskennung: 549300I3S2HFIMB3V932

Ökologische und/oder soziale Merkmale

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

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

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

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

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

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

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

Nein

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

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

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

mit einem sozialen Ziel

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

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „Bezugszeitraum“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für Unternehmensemittenten beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und Landnutzung, Kohlenstoffemissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Wasserstress, Schadstoffemissionen und Abfälle, Finanzierung von Umweltauswirkungen, CO₂-Fußabdruck von Produkten, Umweltpolitik, Umweltmanagementsystem, Programme zur Reduzierung von THG-Emissionen („**THG**“) umweltfreundliche Beschaffungspolitik und Programme für treibhausfreie Luftemissionen.
- **Soziale Merkmale:** Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Schutz der Privatsphäre und Datensicherheit, Produktsicherheit und -qualität, Sicherheit von Finanzprodukten, Diskriminierungspolitik, Programme zur Einbindung der Gemeinschaft, Diversitätsprogramme und Menschenrechtspolitik.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses haben der Manager und der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten den NB-ESG-Quotienten, um die aufgeführten ökologischen und sozialen Merkmale zu bewerten, indem sie primär in Wertpapiere von Emittenten mit einem relativ günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotienten-Rating investierten. Dementsprechend beschränkten der Manager und der Sub-Investment-Manager das Engagement in Emittenten mit dem schlechtesten NB-ESG-Quotienten-Rating, außer es bestand die begründete Erwartung, dass sich das NB-ESG-Quotienten-Rating im Laufe der Zeit verbessern würde. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Bezugszeitraum | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|--------------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | 54 | 1-100 | 69 % |
| Daten von Dritten | 4,2 | 0-10 | |

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

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

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Das Portfolio baut sein Engagement in Kraftwerkskohle schrittweise ab und verbietet Investitionen in Wertpapiere von Emittenten, die mehr als 10 % ihrer Einnahmen aus dem Abbau von Kraftwerkskohle erzielten oder die neue Kohlekraftwerke ausbauten (wie durch interne Prüfungen festgestellt). Das Portfolio untersagte außerdem Investitionen in Emittenten aus der Kraftwerksindustrie, die mehr als 95 % ihrer installierten Kraftwerkskapazitäten aus Kraftwerkskohle bezogen, die in neue Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle expandierten oder deren Investitionsbudgets für Expansionszwecke keine Mindestschwelle für Investitionen in Nicht-Kohle enthielten (wie durch interne Prüfungen festgestellt). Das Portfolio investierte nicht in Wertpapiere von Emittenten, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden oder die nicht mit dieser übereinstimmten, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen in Bezug auf eine verantwortungsbewusste Geschäftsführung („**OECD -Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen. Darüber hinaus schloss das Portfolio Wertpapiere von Emittenten aus, die direkt an Kinderarbeit beteiligt waren, die in der Tabakindustrie tätig waren sowie von bestimmten Emittenten, die ein erhebliches Engagement in Ölsand haben.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich haben der Manager und der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise ihrer Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager erörterten und diskutierten die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund ihres eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlage des Portfolios).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

| | NB-ESG-Quotient-Rating | Rating der Daten durch externe Anbieter | Kombinierte Abdeckung |
|----------------------------|------------------------|---|-----------------------|
| Bereich | 1-100 | 0-10 | 0 %-100 % |
| Bezugszeitraum 2022 | 50 | 4,4 | 67 % |
| Bezugszeitraum 2023 | 54 | 4,2 | 69 % |

Das NB-ESG-Quotient-Rating hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert, und das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich verschlechtert. Dies ist unter Umständen auf eine Verschlechterung bei den einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmen gemäß externem Datenanbieter oder auf Differenzen des von dem Anbieter bereitgestellten externen Rating des Emittenten zurückzuführen.

2. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

| | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|-------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0 |
| Bezugszeitraum 2023 | 0 |

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten. Dessen ungeachtet waren der Manager und der Sub-Investment-Manager nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

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

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

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

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager und den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| PAIs auf Produktebene | |
|-----------------------------------|--|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgasemissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager und den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|---|--|-------------------------|----------|
| CHINA PEOPLES REPUBLIC OF (GOVERNMENT) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 5,5 % | China |
| BRIGHT FOOD (GROUP) CO LTD | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 4,4 % | China |
| CHINA PEOPLES REPUBLIC OF (GOVERNMENT) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 4,4 % | China |
| GUANGZHOU YUEXIU HOLDING LTD MTN | F – Baugewerbe/Bau | 4,4 % | China |
| CHINA SOUTHERN POWER GRID CO LTD MTN | D – Energieversorgung | 4,4 % | China |
| SHENZHEN METRO GROUP CO LTD | H - Verkehr und Lagerei | 3,3 % | China |
| CENTRAL HUIJIN INVESTMENT LTD MTN | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 3,3 % | China |
| CHINA RESOURCES CO LTD MTN | G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 3,3 % | China |
| BOC AVIATION (USA) CORPORATION MTN RegS | N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 3,0 % | Singapur |
| GUANGZHOU METRO INVESTMENT FINANCE MTN RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 2,8 % | China |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 2,2 % | China |
| BANK OF CHINA LTD RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 2,2 % | China |
| CHINA POST GROUP | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 2,2 % | China |
| CHINA PEOPLES REPUBLIC OF (GOVERNMENT) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 2,2 % | China |
| CENTRAL HUIJIN INVESTMENT LTD MTN | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 2,2 % | China |

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.



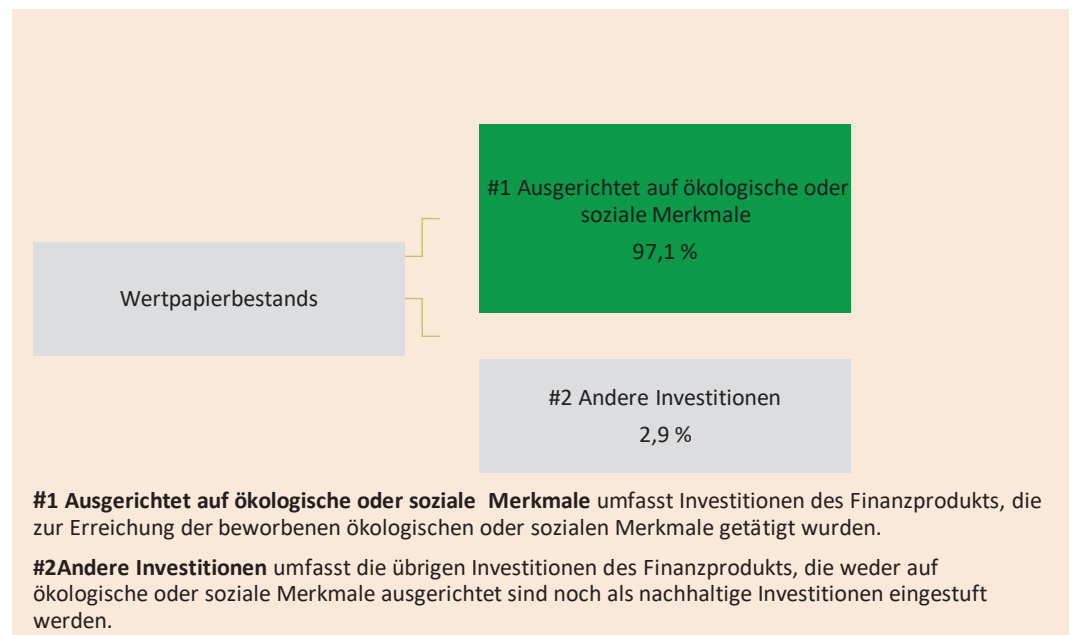
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 97,1 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 2,9 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berechneten den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager und der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatten. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



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

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|--|-------------------------|
| C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 13,6 % |
| D – Energieversorgung | 8,2 % |
| F – Baugewerbe/Bau | 6,6 % |
| G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 4,2 % |
| H - Verkehr und Lagerei | 4,7 % |
| I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie | 0,4 % |
| J – Information und Kommunikation | 1,7 % |
| K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 37,7 % |
| N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 4,9 % |
| O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 17,4 % |
| R – Kunst, Unterhaltung und Erholung | 0,2 % |
| Keine | 0,3 % |

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

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

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine 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?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager können bestätigen, dass das Portfolio in Investitionen investiert hat, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager und der Sub-Investment-Manager werden das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessert.

● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

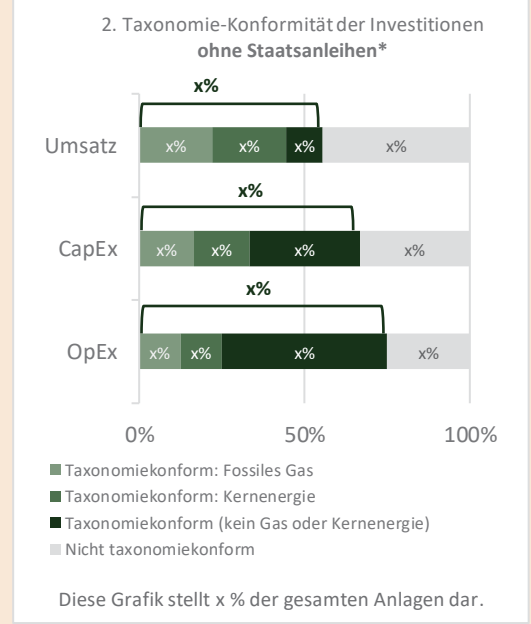
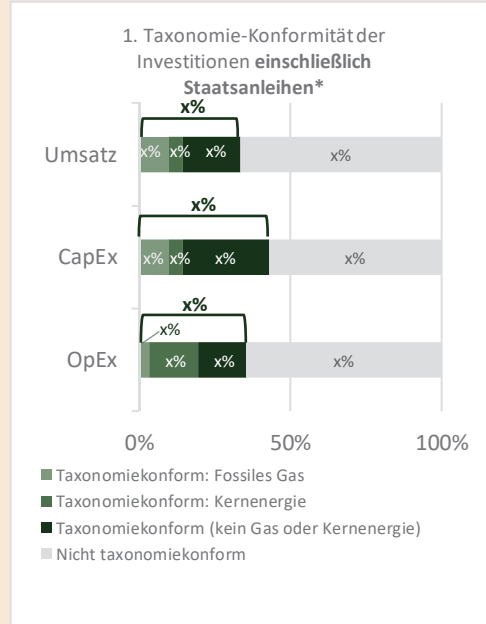
Nein

¹ Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



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

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager und der Sub-Investment-Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachteten, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen, verhinderten und sie sicherstellen, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager wendeten bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager verstehen unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Managers und des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers und des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager und vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in seine internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager engagierten sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager betrachteten diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil ihres Anlageprozesses. Die Fortschritte bei der Einbindung wurden vom Manager und dem Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

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

k.A.

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

k.A.

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

k.A.

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

k.A.

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

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Climate Innovation Fund (das „Portfolio“)

Unternehmenskennung: 5493000I8IKJFVXLQ109

Ökologische und/oder soziale Merkmale

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

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

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

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

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

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

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

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 82,6 %* an nachhaltigen Investitionen.

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

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

mit einem sozialen Ziel

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

*Weitere Einzelheiten zur Vermögensallokation des Portfolios (einschließlich des Engagements in nachhaltige Investitionen) finden Sie unter der Frage „*Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?*“

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [here](#).

Das Portfolio wurde am 1. August 2023 aufgelegt und diese periodische Berichtsvorlage wurde daher auf der Grundlage des Durchschnitts der Werte zum Ende des dritten und vierten Quartals 2023 (der „Bezugszeitraum“) erstellt.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

Ökologische Merkmale: Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.

Zwecks der Ausrichtung des Portfolios auf ein Netto-Null-Ziel beabsichtigt der Sub-Investment-Manager bis 2030 mindestens 90 % des Nettoinventarwerts des Portfolios in Unternehmen mit von der Science-Based Target Initiative („SBTi“)¹ validierten Zielen (oder gleichwertigen Zielen gemäß der Net-Zero-Sector-Alignment-Methode von Neuberger Berman, die mit den Zielvorgaben des IIGCC übereinstimmt)² zu investieren und bis 2050 100 % des Nettoinventarwerts des Portfolios zu erreichen. Darüber hinaus muss das Portfolio seinen CO₂-Fußabdruck in Bezug auf Scope-1-, Scope-2- und wesentliche Scope-3-THG-Emissionen³ um mindestens 30 % bis 2030 im Vergleich zum Basisjahr 2019 reduzieren und einen anschließenden Rückgang auf Null netto bis 2050 erreichen. Das Basisjahr 2019 kann neu berechnet werden, wenn sich die Datenqualität und die Offenlegung im Laufe der Zeit verbessern, insbesondere in Bezug auf die Scope-3-Emissionen. Es existiert kein jährliches Reduktionsziel. Stattdessen wird sich auf das Zwischenziel 2030 und das Netto-Null-Ziel 2050 konzentriert.

Soziale Merkmale: Zugang zu Finanzmitteln und zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Anreize für Mitarbeiter und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsnormen in der Lieferkette, Vielfalt und Integration der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortungsvolles Marketing.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

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

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „NB- ESG-Quotient“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („NB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sekorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen

¹ Die Science Based Targets initiative (SBTi) ist eine Partnerschaft zwischen dem Carbon Disclosure Project (CDP), dem Globalen Pakt der Vereinten Nationen (UNGC), dem Weltressourceninstitut (WRI) und dem World Wide Fund for Nature, die es Unternehmen ermöglicht, wissenschaftlich fundierte Emissionsreduktionsziele festzulegen.

² The Institutional Investors Group on Climate Change (IGCC) hat das Net Zero Investment Framework geschaffen, um Vermögensbesitzern und Vermögensverwaltern bei der Entwicklung von Netto-Null-Investitionsstrategien oder der Erfüllung von Netto-Null-Verpflichtungen zu unterstützen. Die Zielvorgaben der IIGCC formen eine Komponente des Net Zero Investment Framework.

³ Scope-1-Emissionen sind direkte Emissionen aus Quellen, die sich im Besitz des Emittenten befinden oder von ihm kontrolliert werden (z. B. Emissionen, die sich direkt durch die Geschäftsprozesse des Emittenten oder durch Fahrzeuge im Besitz des Emittenten ergaben). Scope-2-Emissionen sind indirekte Emissionen aus der Erzeugung von Strom, Dampf, Wärme und Kälte, die vom Emittenten verbraucht wurden. Scope-3-Emissionen sind alle anderen indirekten Emissionen, die in der Wertschöpfungskette eines Emittenten anfallen (u. a. Emissionen aus den vom Emittenten verbrauchten Produkten oder Dienstleistungen, aus der Entsorgung seiner Abfälle, aus dem Pendelverkehr seiner Mitarbeiter, aus dem Vertrieb und Transport seiner Produkte oder aus seinen Investitionen).

interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistenteam für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient- oder externes Rating aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachen) zu erreichen.

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Bildung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende des dritten und vierten Kalenderquartals berechnet.

| Bezugszeitraum | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|---|----------------|-------------------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | ES:B G: 2,7 | ES: A-D G: 1-4 | 96 % |
| Rating der Daten durch externe Anbieter | 6,8 | 0-10 | |

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale („ES“) werden die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („G“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („CVaR“) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und der Chancen durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 9,5 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnitt der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 96 %, was einem ein Durchschnitt der CVaR-Abdeckung über die vier Kalenderquartalsenden hinweg entspricht.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy und die Neuberger Berman Enhanced Sustainable Exclusion Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

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

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat, wie nachstehend erläutert, und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Unternehmens, um festzustellen, ob das Unternehmen einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Unternehmens auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Sub-Investment-Manager überprüfte die Unternehmen auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Unternehmen dieser Prüfung standhielten, quantifizierte der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag der Unternehmen zur Wirtschaft.

Der Sub-Investment-Manager erfasste dies auf zwei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDGs“).

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbaren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

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

Der Sub-Investment-Manager wandte seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigten. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „PAIs“):

| PAIs | |
|-----------------------------------|---|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgasemissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind PAI 5 - Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren |
| <i>Biodiversität</i> | PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken |
| <i>Wasser</i> | PAI 8 - Emissionen in Wasser |
| <i>Abfall</i> | PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

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.

Der Sub-Investment-Manager hat auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

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

Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

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

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

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.
2. Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „PAIs auf Produktebene“):

| PAIs auf Produktebene | |
|----------------------------|--|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| Treibhausgasemissionen | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| Soziales und Beschäftigung | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbar Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und

- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem zum dritten und vierten Kalenderquartalsende des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|------------------------------------|--|-------------------------|------------|
| NVENT ELECTRIC PLC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 6,10 % | USA |
| GFL ENVIRONMENTAL SUBORDINATE VOTI | E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen | 5,97 % | Kanada |
| PROCORE TECHNOLOGIES INC | J – Information und Kommunikation | 5,61 % | USA |
| QUANTA SERVICES INC | F – Baugewerbe/Bau | 5,29 % | USA |
| HOWMET AEROSPACE INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 5,27 % | USA |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 4,16 % | USA |
| DSM FIRMENICH AG | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 3,69 % | Schweiz |
| INGERSOLL RAND INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 3,60 % | USA |
| STELLANTIS NV | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 3,38 % | USA |
| HITACHI LTD | J – Information und Kommunikation | 3,11 % | Japan |
| BUREAU VERITAS SA | M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen | 3,00 % | Frankreich |
| GREEN PLAINS INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,77 % | USA |
| BYD LTD H | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,57 % | China |
| XYLEM INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,38 % | USA |
| IBERDROLA SA | D – Energieversorgung | 2,32 % | Spanien |



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

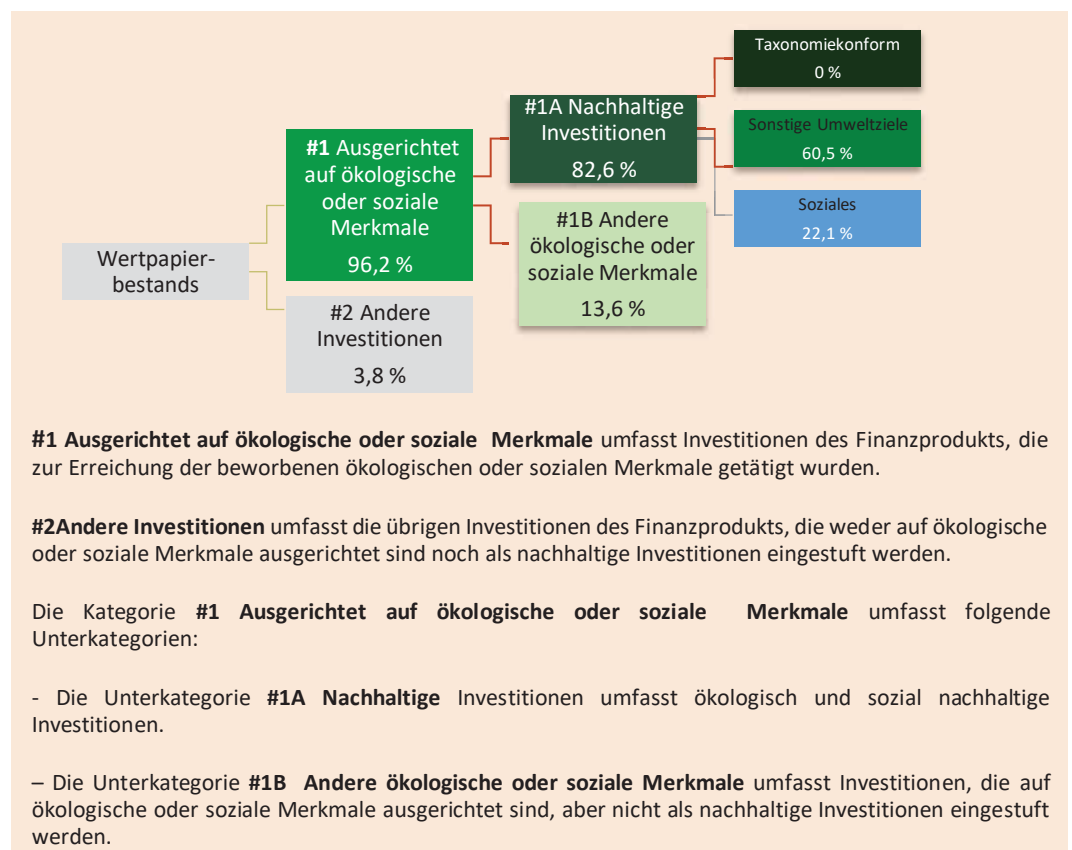
Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 96,2 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio verpflichtet sich, mindestens 50 % an nachhaltigen Investitionen zu halten. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 82,6 % an nachhaltigen Investitionen.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 3,8 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Bildung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende des dritten und vierten Kalenderquartals berechnet.



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

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Bildung des Durchschnitts der Werte zum Ende des dritten und vierten Kalenderquartals berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|--|-------------------------|
| C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 64,4 % |
| D – Energieversorgung | 2,4 % |
| E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen | 7,5 % |
| F – Baugewerbe/Bau | 5,8 % |
| G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 2,0 % |
| H – Verkehr und Lagerei | 1,8 % |
| J – Information und Kommunikation | 12,9 % |
| M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen | 3,1 % |



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

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

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine 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?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert⁴?

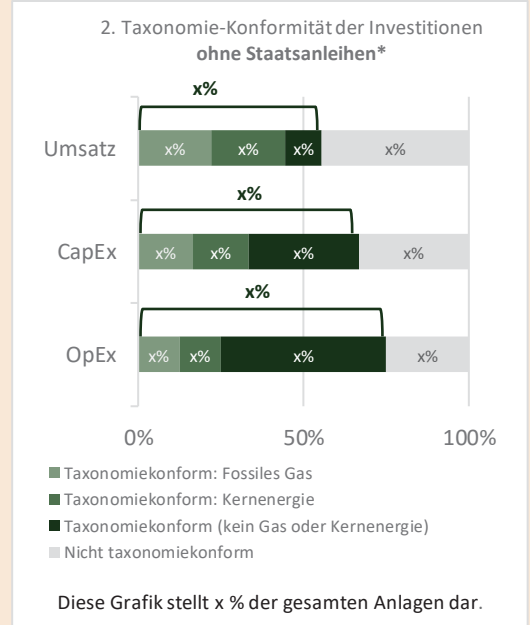
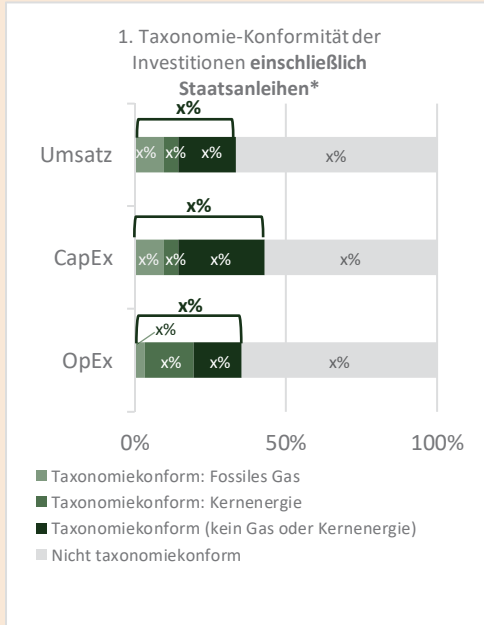
- Ja:
- In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

⁴ Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



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

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Das Portfolio hielt 60,5 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, das nicht mit der EU-Taxonomie konform ist.



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?

Das Portfolio hielt 22,1 % an sozial nachhaltigen Investitionen.



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

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das externe oder NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung eines Unternehmens besser zu erkennen, wobei darauf hingewiesen wird, dass der Schwerpunkt des Portfolios auf Investitionen in Unternehmen liegt, die an Technologien und/oder Aktivitäten im Zusammenhang mit der Klima-Innovation beteiligt sind oder davon profitieren.

Der Sub-Investment-Manager nutzte den NB-ESG-Quotienten und eine Bewertung der thematischen Reinheit zwecks Identifikation von Unternehmen, die im Bereich des langfristigen Trends der Klimainnovation operieren. Beteiligungen mit thematischer Reinheit werden als solche definiert, bei denen mindestens 50 % des zusätzlichen Gewinn-/Umsatzwachstums oder der Investitionsausgaben auf Aktivitäten im Zusammenhang mit der Klimainnovation ausgerichtet sind.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die thematische Beurteilung und die Gesamtbeurteilung des Unternehmens bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wendete das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

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

k.A.

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

k.A.

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

k.A.

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

k.A.

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

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund (das „Portfolio“)

Unternehmenskennung: 549300TMYI9EFR4Q1G47

Ökologische und/oder soziale Merkmale

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

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

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

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

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

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

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

Nein

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 36,2 %* an nachhaltigen Investitionen**

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

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

mit einem sozialen Ziel

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

*Das Portfolio führte zum 2. August 2023 eine Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen von 10 % ein. Die Angaben zu nachhaltigen Investitionen in dieser periodischen Berichtsvorlage wurden daher auf Grundlage des Durchschnitts aus den Werten zum Ende des dritten und vierten Quartals 2023 (als die einzigen Quartalsenden nach Einführung der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen) erstellt. Die Zahlen zu den nachhaltigen Investitionen sind, bedingt durch die uneinheitlichen Bezugszeiträume, nicht in der Tabelle zur Vermögensallokation enthalten.

**Weitere Einzelheiten zur Vermögensallokation des Portfolios (einschließlich des Engagements bei nachhaltigen Investitionen) finden Sie nachfolgend unter der Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO₂-Fußabdrucks, Umweltmanagement, Treibhausgasemissionen („**THG**“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, Gelegenheiten für erneuerbare Energien, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikoübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen in der Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

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

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**MB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des

Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Emittenten ein, die einen schlechten NB-ESG-Quotienten aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachen) zu erreichen.

| Bezugszeitraum | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | 59 | 1-100 | 100 % |
| Daten von Dritten | 7,3 | 0-10 | |

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch den Durchschnitt der Daten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet, wobei für die Bewertung des NB-ESG-Quotienten ein Rating zwischen 1 und 100 verwendet wird, wobei 1 die niedrigste und 100 das höchste Rating darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmensemittenten gemessen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und Chancen durch den Klimawandel pro Emission und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit eine Emission durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 5,4 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 56 %, was einem Durchschnitt der vier Kalenderquartalsenden entspricht.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Seit dem 6. Dezember 2023 verbietet der Sub-Investment-Manager ebenfalls den Kauf von Wertpapieren von Unternehmen, die an der Herstellung von Tabakprodukten wie Zigarren, Zigaretten, E-Zigaretten, rauchfreiem Tabak, auflösbarem Tabak und Kautabak beteiligt sind. Dies schloss auch Unternehmen ein, die Rohtabakblätter anbauen oder verarbeiteten.

Zudem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlage des Portfolios).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

| | NB-ESG-Quotient-Rating | Rating der Daten durch externe Anbieter | Kombinierte Abdeckung |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| Bereich | 1-100 | 0-10 | 0-100 % |
| Bezugszeitraum 2022 | 58 | 6,9 | 96 % |
| Bezugszeitraum 2023 | 59 | 7,3 | 100 % |

Die Bewertung des NB-ESG-Quotienten hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

Das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen sowie auf potenzielle Änderungen oder Unterschiede im externen Emittenten-Rating.

2. CVaR

| | CVaR | Abdeckung |
|----------------------------|-------------|------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | -5,2 % | 41 % |
| Bezugszeitraum 2023 | -5,4 % | 56 % |

Die CVaR-Prognose hat sich im Vergleich zum Vorjahr aufgrund von einer verbesserten Datenabdeckung bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmensemittenten und Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmensemittenten sowie Handelsaktivitäten im Portfolio verändert.

Die CVaR-Abdeckung des Portfolios hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf eine verbesserte Datenabdeckung bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmensemittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

| | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|--------------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0 |
| Bezugszeitraum 2023 | 0 |

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

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es während des Bezugszeitraums kein nachhaltiges Anlageziel. Seit dem 2. August 2023 hat sich das

Portfolio dazu verpflichtet, mindestens 10 % nachhaltige Investitionen zu halten. Die nachhaltigen Investitionen bewarben die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat (wie nachstehend erläutert) und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Emittenten, um festzustellen, ob der Emittent einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Emittenten auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Sub-Investment-Manager überprüfte die Emittenten auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Emittenten diese Prüfung bestanden haben, hat der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag des Emittenten zur Wirtschaft gemessen.

Der Sub-Investment-Manager erfasste dies auf zwei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDGs“).

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbaren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

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

Seit dem 2. August 2023 wendet der Sub-Investment-Manager seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigen. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „PAIs“):

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

| PAIs | |
|-----------------------------------|---|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgas-emissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind PAI 5 - Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren |
| <i>Biodiversität</i> | PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken |
| <i>Wasser</i> | PAI 8 - Emissionen in Wasser |
| <i>Abfall</i> | PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte ferner Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen und investierte nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden oder nicht mit diesen übereinstimmen, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

— — —
Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Emittenten, die quantitative und qualitative Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI festgelegt wurden, unterschreiten;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Emittenten, wenn sie unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

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

Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

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

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

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

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „*Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?*“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.
2. Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| PAIs auf Produktebene | |
|-----------------------------------|--|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgasemissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbar Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|---|--|-------------------------|----------------|
| NGG FINANCE PLC RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 7,1 % | Großbritannien |
| ELECTRICITE DE FRANCE SA MTN RegS | D – Energieversorgung | 4,9 % | Frankreich |
| SOUTHERN ELECTRIC GENERATING CO | D – Energieversorgung | 4,6 % | USA |
| VODAFONE GROUP PLC \$60NC6 MTN RegS | J – Information und Kommunikation | 4,3 % | Großbritannien |
| CENTRICA PLC RegS | D – Energieversorgung | 4,0 % | Großbritannien |
| ENBRIDGE INC | H – Verkehr und Lagerung | 3,3 % | Kanada |
| ENBW ENERGIE BADEN WUERTTEMBER NC7 RegS | D – Energieversorgung | 2,7 % | Deutschland |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT SA NC5.5 RegS | E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen | 2,5 % | Frankreich |
| BAYER AG RegS | | 2,4 % | Deutschland |
| BP CAPITAL MARKETS PLC RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 2,3 % | Großbritannien |
| FIRMENICH INTERNATIONAL SA RegS | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,3 % | Schweiz |
| AUSNET SERVICES HOLDINGS PTY LTD RegS | D – Energieversorgung | 2,3 % | Australien |
| BRITISH TELECOMMUNICATIONS PLC RegS | J – Information und Kommunikation | 2,2 % | Großbritannien |
| VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE N RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 2,1 % | Deutschland |
| ELIA GROUP SA RegS | D – Energieversorgung | 1,9 % | Belgien |



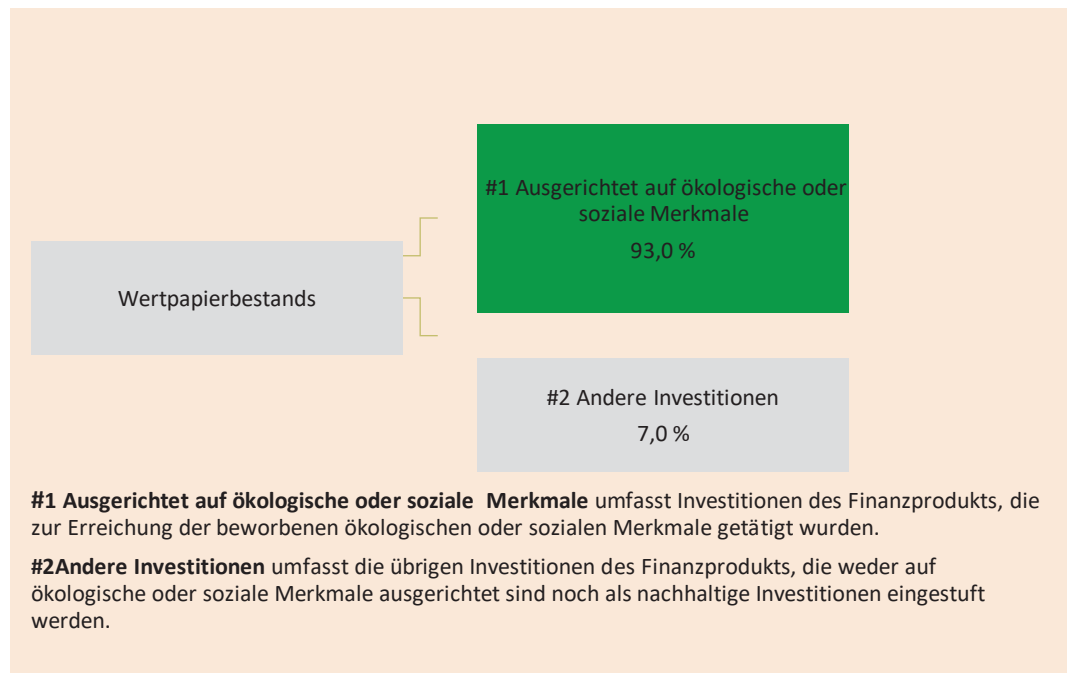
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 93,0 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio führte zum 2. August 2023 eine Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen von 10 % ein. Die Angaben zu nachhaltigen Investitionen in diesem regelmäßigen Bericht wurden daher auf Grundlage des Durchschnitts der Werte zum dritten und vierten Quartalsende 2023 (als die einzigen Quartalsenden nach Einführung der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen) erstellt. Das Portfolio hielt 36,2 % an nachhaltigen Investitionen.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 7,0 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Der Bezugszeitraum für die nachstehenden Daten ist ein Durchschnitt der vier Kalenderquartalsenden 2023, mit Ausnahme der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen. In diesem Falle wurden die Daten für diesen Bezugszeitraum lediglich auf Grundlage der Portfoliobeteiligungen zum Ende des dritten und vierten Quartals 2023 erstellt.



Der prozentuale Anteil der nachhaltigen Investitionen zum 31. Dezember 2023 betrug 36,2 %.

Darin enthalten waren 35,7 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, und 0,5 % an sozial nachhaltigen Investitionen. Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

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

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Bildung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|--|-------------------------|
| B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden | 0,0 % |
| C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 14,2 % |
| D – Energieversorgung | 36,1 % |
| E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen | 5,5 % |
| G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 0,0 % |
| H – Verkehr und Lagerei | 3,8 % |
| I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie | 0,0 % |
| J – Information und Kommunikation | 14,8 % |
| K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 22,5 % |
| L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 3,0 % |
| M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen | 0,0 % |
| N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 0,0 % |
| O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 0,0 % |
| Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen | 0,0 % |
| U – Extraterritoriale Organisationen und Körperschaften | 0,0 % |
| Keine | 0,0 % |

O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

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

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine 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

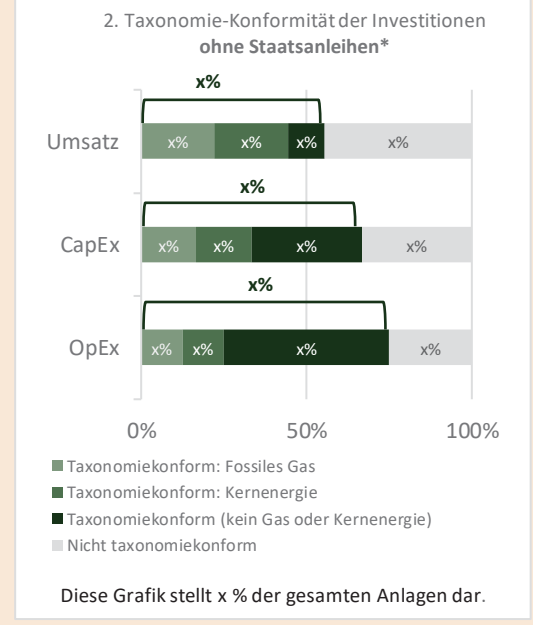
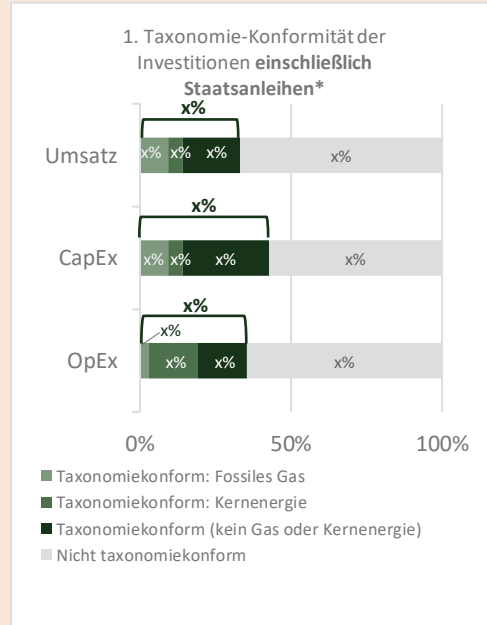
Nein

¹ Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



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

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Das Portfolio führte zum 2. August 2023 eine Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen von 10 % ein. Die Angaben zu nachhaltigen Investitionen in dieser periodischen Berichtsvorlage wurden daher auf Grundlage des Durchschnitts aus den Werten zum Ende des dritten und vierten Quartals 2023 (als die einzigen Quartalsenden nach Einführung der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen) erstellt. Das Portfolio hielt 35,7 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, das nicht mit der EU-Taxonomie konform ist.



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?

Das Portfolio führte zum 2. August 2023 eine Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen von 10 % ein. Die Angaben zu nachhaltigen Investitionen in dieser periodischen Berichtsvorlage wurden daher auf Grundlage des Durchschnitts aus den Werten zum Ende des dritten und vierten Quartals 2023 (als die einzigen Quartalsenden nach Einführung der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen) erstellt. Das Portfolio hielt 0,5 % an sozial nachhaltigen Investitionen.



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

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in seine internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Er strebte danach, konstruktiven Dialogen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
k.A.

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

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Developed Market FMP – 2027 (das „Portfolio“)

Unternehmenskennung: 549300GF7EOMWXAHXG64

Ökologische und/oder soziale Merkmale

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

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

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

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

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

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

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

Nein

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

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

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

mit einem sozialen Ziel

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

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Das Portfolio wurde am 31. Juli 2023 aufgelegt und diese periodische Berichtsvorlage wurde daher auf der Grundlage des Durchschnitts der Werte zum Ende des dritten und vierten Quartals 2023 (der „Bezugszeitraum“) erstellt.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben zudem die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung dieser ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Angesichts des Anlageziels, der Anlagedauer und des Fälligkeitsdatums am 31. Juli 2027 (das „**Fälligkeitsdatum**“) war der Portfolioumschlag begrenzt. Obwohl das Portfolio während seiner gesamten Lebensdauer ökologische und soziale Merkmale beworben wird, konzentrierte sich die Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale auf die Aufbauphase des Portfolios.

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO₂-Fußabdrucks, Umweltmanagement, Treibhausgasemissionen („**THG**“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, Gelegenheiten für erneuerbare Energien, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikoübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen in der Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**MB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistentams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergreift, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühte sich der Sub-Investment-Manager, konstruktiven Dialogen bei Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

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

| Bezugszeitraum | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | 60 | 1-100 | 100 % |
| Daten von Dritten | 6,4 | 0-10 | |

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet. Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmensemittenten gemessen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und Chancen durch den Klimawandel pro Emission und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit eine Emission durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Wertverlust von 10,1 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 83 %, was einem Durchschnitt der CVaR-Abdeckung über die vier Kalenderquartalsenden hinweg entspricht.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

Da das Portfolio darauf abzielte, eine Rendite über eine bestimmte Laufzeit zu erzielen, die am Fälligkeitsdatum endet, war der Portfolioumschlag begrenzt.

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

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten. Dessen ungeachtet war der Sub-Investment-Manager nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

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

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

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

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| PAIs auf Produktebene | |
|-----------------------------------|--|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgas-emissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem über die vier Kalenderquartalsenden des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitt basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|---|--|-------------------------|----------------|
| FORD MOTOR CREDIT COMPANY LLC | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 2,5 % | USA |
| AIR LEASE CORPORATION | N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 2,4 % | USA |
| SANTANDER UK GROUP HOLDINGS PLC | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 2,4 % | Großbritannien |
| AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCA | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 2,4 % | Irland |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 2,4 % | Großbritannien |
| MORGAN STANLEY MTN | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 2,3 % | USA |
| HSBC HOLDINGS PLC | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 2,3 % | Großbritannien |
| GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 2,3 % | USA |
| PRIME SECURITY SERVICES BORROWER L RegS | N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 2,3 % | USA |
| BPCE SA MTN 144A | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 2,2 % | Frankreich |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORPORATION | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 2,2 % | USA |
| MICRON TECHNOLOGY INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,2 % | USA |
| IMPERIAL BRANDS FINANCE PLC 144A | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 2,2 % | Großbritannien |
| BNP PARIBAS 144A | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 2,1 % | Frankreich |
| STELLANTIS FINANCE US INC 144A | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,0 % | USA |



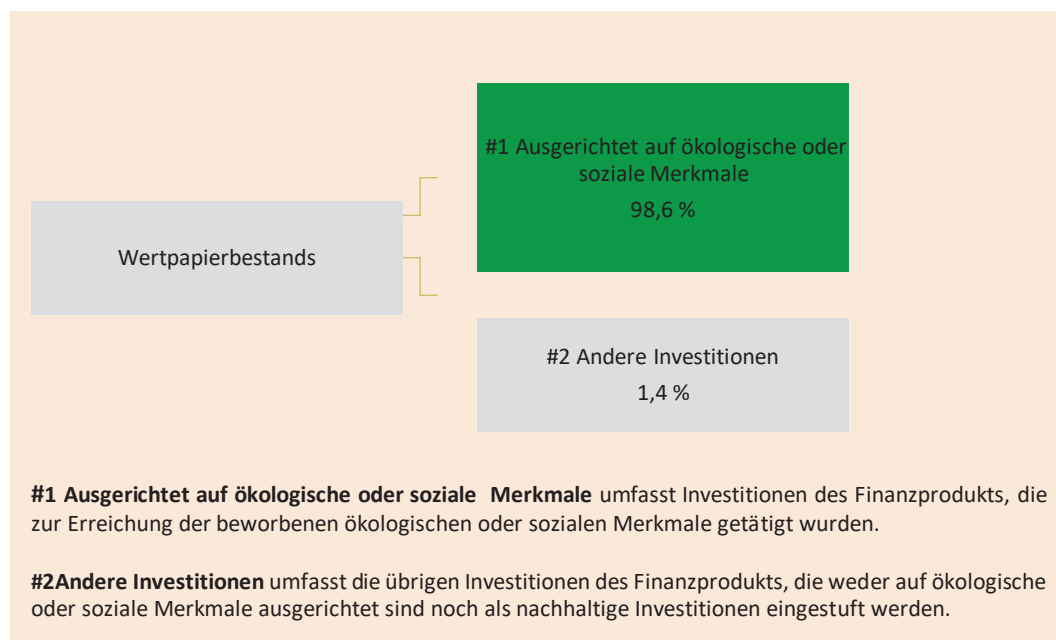
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 98,6 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 1,4 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder Dritten beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



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

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|--|-------------------------|
| B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden | 3,1 % |
| C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 15,6 % |
| D – Energieversorgung | 4,5 % |
| G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 0,3 % |
| H – Verkehr und Lagerei | 11,0 % |
| J – Information und Kommunikation | 10,2 % |
| K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 43,0 % |
| L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 2,1 % |
| N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 7,1 % |
| Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen | 2,0 % |
| R – Kunst, Unterhaltung und Erholung | 1,2 % |



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

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

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine 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?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

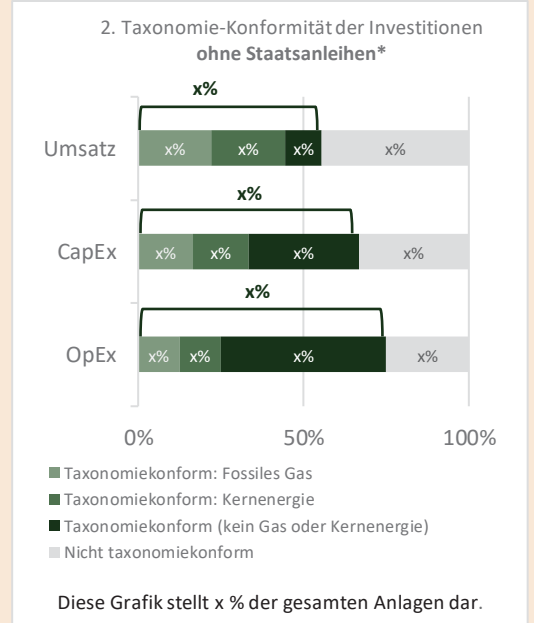
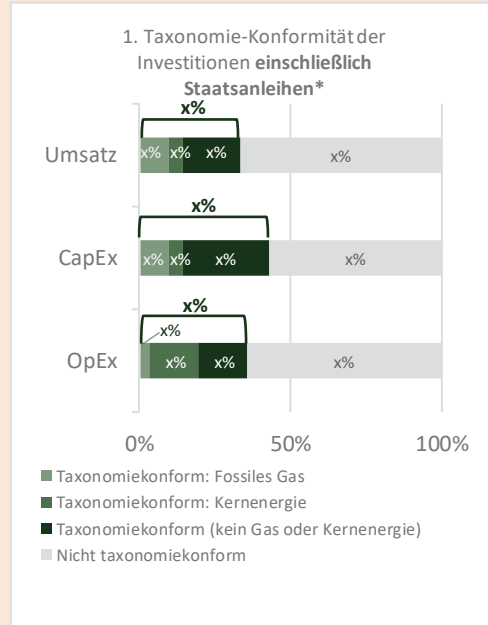
Nein

¹ Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



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

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

In Anbetracht des Anlageziels, der Anlagedauer und des Fälligkeitstermins des Portfolios werden zwar während der gesamten Laufzeit des Portfolios ökologische und soziale Merkmale beworben, doch konzentrierte sich die Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale auf die Aufbauphase des Portfolios, da es die Absicht des Sub-Investment-Manager war, einen geringen Portfolioumschlag zu haben.

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittenteanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Sub-Investment-Manager erachtete diese Zusammenarbeit mit Emittenten als wichtigen Bestandteil seines Anlageprozesses, der es ihm ermöglichte sicherzustellen, dass die erstmalige Beurteilung des Emittenten (bei Auflage) weiterhin zutreffend war und in die laufende Bewertung durch das NB-ESG-Quotient-Rating einfluss. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verwendet keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
k.A.

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

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Emerging Market Debt – Hard Currency Fund (das „Portfolio“)

Unternehmenskennung: 549300M7KHGG3BTZ3979

Ökologische und/oder soziale Merkmale

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

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

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

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

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

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

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

Nein

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

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

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

mit einem sozialen Ziel

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

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „Bezugszeitraum“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für staatliche Emittenten beworben:

- **Ökologische Merkmale:** staatliche Energieeffizienz, Anpassung an den Klimawandel, Entwaldung, Treibhausgasemissionen („THG“) , Luft- und Haushaltsverschmutzung und unsichere sanitäre Einrichtungen.
- **Soziale Merkmale:** Fortschritte bei den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, „SDGs“), Gesundheits- und Bildungsniveau, Qualität der Regulierung, politische Stabilität und Freiheiten, Gleichstellung der Geschlechter sowie Forschung und Entwicklung.

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für Unternehmensemittenten beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und Landnutzung, Kohlenstoffemissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Wasserstress, Schadstoffemissionen und Abfälle, Finanzierung von Umweltauswirkungen, CO₂-Fußabdruck von Produkten, Umweltpolitik, Umweltmanagementsystem, Programme zur Reduzierung von THG-Emissionen, umweltfreundliche Beschaffungspolitik und Programme für treibhausfreie Luftemissionen.
- **Soziale Merkmale:** Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Schutz der Privatsphäre und Datensicherheit, Produktsicherheit und -qualität, Sicherheit von Finanzprodukten, Diskriminierungspolitik, Programme zur Einbindung der Gemeinschaft, Diversitätsprogramme und Menschenrechtspolitik.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Im Rahmen des Anlageprozesses haben der Manager und der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten den NB-ESG-Quotienten, um die aufgeführten ökologischen und sozialen Merkmale zu bewerben, indem sie primär in Wertpapiere von Emittenten mit einem relativ günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotienten-Rating investierten. Dementsprechend beschränkten der Manager und der Sub-Investment-Manager das Engagement in Emittenten mit dem schlechtesten NB-ESG-Quotienten-Rating, außer es bestand die begründete Erwartung, dass sich das NB-ESG-Quotienten-Rating im Laufe der Zeit verbessern würde.

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Bezugszeitraum | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|--------------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | 52 | 1-100 | 97 % |
| Daten von Dritten | 3,9 | 0-10 | |

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

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Das Portfolio baut sein Engagement in Kraftwerkskohle schrittweise ab und verbietet Investitionen in Wertpapiere von Emittenten, die mehr als 10 % ihrer Einnahmen aus dem Abbau von Kraftwerkskohle erzielten oder die neue Kohlekraftwerke ausbauen (wie durch interne Prüfungen festgestellt). Das Portfolio untersagte außerdem Investitionen in Emittenten aus der Kraftwerksindustrie, die mehr als 95 % ihrer installierten Kraftwerkskapazitäten aus Kraftwerkskohle bezogen, die in neue Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle expandierten oder deren Investitionsbudgets für Expansionszwecke keine Mindestschwelle für Investitionen in Nicht-Kohle enthielten (wie durch interne Prüfungen festgestellt). Das Portfolio investiert nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen. Darüber hinaus schloss das Portfolio Wertpapiere von Emittenten aus, die 5 % oder mehr ihrer Umsätze aus der Herstellung von Tabakerzeugnissen erzielten. Emittenten, die an direkter Kinderarbeit beteiligt waren, und Emittenten, die mehr als 10 % der Umsätze aus der Ölsandgewinnung erzielten, wurden ebenfalls ausgeschlossen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich haben der Manager und der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise ihrer Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager erörterten und diskutierten die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund ihres eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlage des Portfolios).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

| | NB-ESG-Quotient-Rating | Rating der Daten durch externe Anbieter | Kombinierte Abdeckung |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| Bereich | 1-100 | 0-10 | 0 %-100 % |
| Bezugszeitraum 2022 | 51 | 3,8 | 96 % |
| Bezugszeitraum 2023 | 52 | 3,9 | 97 % |

Die Bewertung des NB-ESG-Quotienten hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

Das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen sowie auf potenzielle Änderungen oder Unterschiede im externen Emittenten-Rating.

2. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

| | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|--------------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0 |
| Bezugszeitraum 2023 | 0 |

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten. Dessen ungeachtet waren der Manager und der Sub-Investment-Manager nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

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

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

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager und den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten in Bezug auf die Nachhaltigkeitsfaktoren die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 1 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für Unternehmensemittenten (die „**PAIs für Unternehmensemittenten**“), und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 2 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für staatliche Emittenten (die „**staatliche PAIs**“) (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“):

| Teil 1 – PAIs für Unternehmensemittenten | |
|---|--|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgas-emissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |
| Teil 2 – staatliche PAIs | |
| <i>Umwelt</i> | PAI 15 - THG-Emissionsintensität |
| <i>Soziales</i> | PAI 16 - Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager und den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts** entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|---|---|-------------------------|------------------------|
| SOUTHERN GAS CORRIDOR CJSK RegS | H - Verkehr und Lagerei | 2,2 % | Aserbaidshar |
| ARGENTINA REPUBLIC OF GOVERNMENT | O - Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 2,0 % | Argentinien |
| PETROLEOS MEXICANOS | B - Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden | 1,7 % | Mexiko |
| MEXICO (UNITED MEXICAN STATES) | O - Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,6 % | Mexiko |
| EL SALVADOR REPUBLIC OF (GOVERNMENT) RegS | O - Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,4 % | El Salvador |
| OMAN GOVERNMENT BOND MTN RegS | O - Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,4 % | Oman |
| ANGOLA GOVERNMENT BOND RegS | O - Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,3 % | Angola |
| ECUADOR REPUBLIC OF (GOVERNMENT) RegS | O - Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,3 % | Ecuador |
| DOMINICAN REPUBLIC (GOVERNMENT) RegS | O - Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,3 % | Dominikanisch Republik |
| COTE D IVOIRE REPUBLIC OF RegS | O - Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,2 % | Elfenbeinküste |
| NK KAZMUNAYGAZ AO RegS | B - Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden | 1,2 % | Kasachstan |
| SERBIA (REPUBLIC OF) RegS | O - Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,2 % | Republik Serbi |
| QATAR GOVERNMENT BOND RegS | O - Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,2 % | Katar |
| ROMANIA (REPUBLIC OF) RegS | O - Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,2 % | Rumänien |
| STATE OIL CO OF THE AZERBAIJAN REP RegS | B - Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden | 1,2 % | Aserbaidshar |

*O - Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.



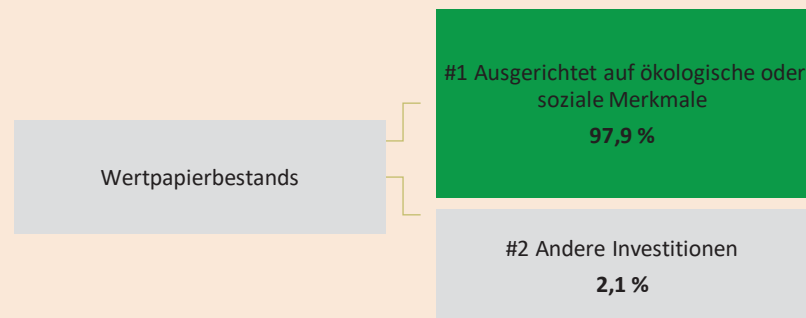
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 97,9 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 2,1 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berechneten den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager und der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatten. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



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

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

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|--|-------------------------|
| B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden | 8,9 % |
| C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,9 % |
| D – Energieversorgung | 3,4 % |
| E – Wasserversorgung, Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen | 0,0 % |
| F – Baugewerbe/Bau | 0,1 % |
| G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 1,2 % |
| H – Verkehr und Lagerei | 3,0 % |
| I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie | 0,0 % |
| J – Information und Kommunikation | 0,3 % |
| K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 11,4 % |
| L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 0,3 % |
| N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 0,1 % |
| O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 65,1 % |
| R – Kunst, Unterhaltung und Erholung | 0,0 % |
| U – Extraterritoriale Organisationen und Körperschaften | 1,5 % |
| Keine | 1,7 % |

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: *Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.*



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

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

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager können bestätigen, dass das Portfolio in Investitionen investiert hat, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager und der Sub-Investment-Manager werden das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

Ja:

In fossiles Gas In Kernenergie

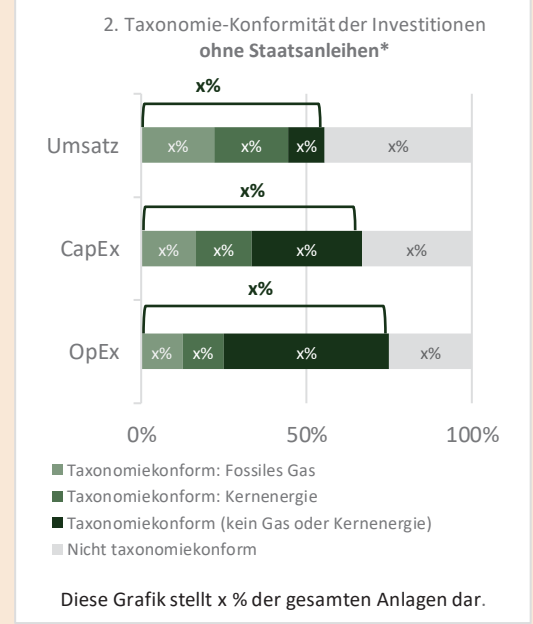
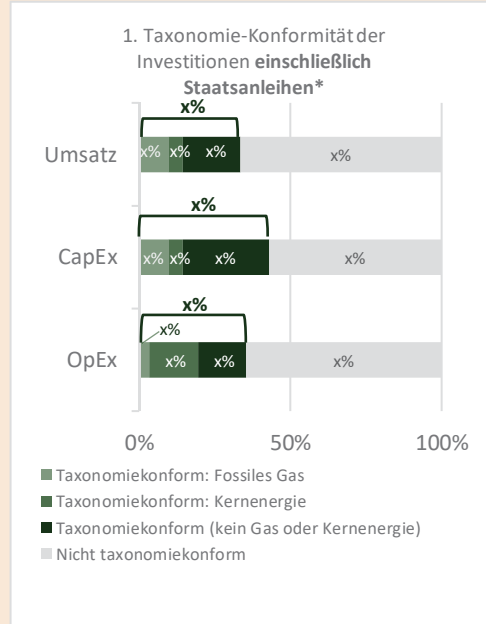
Nein

¹ Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



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

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager und der Sub-Investment-Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachteten, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen, verhinderten und sie sicherstellen, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager wendeten bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager verstehen unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Managers und des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers und des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager und vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager engagierten sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager betrachteten diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil ihres Anlageprozesses. Die Fortschritte bei der Einbindung wurden vom Manager und dem Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert

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

k.A.

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

k.A.

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

k.A.

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

k.A.

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

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Emerging Market Debt – Local Currency Fund (das „Portfolio“)

Unternehmenskennung: 549300VLRPBFFXL0DB81

Ökologische und/oder soziale Merkmale

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

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

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

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

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

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

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

Nein

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

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

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

mit einem sozialen Ziel

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

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für staatliche Emittenten beworben:

- **Ökologische Merkmale:** staatliche Energieeffizienz, Anpassung an den Klimawandel, Entwaldung, Treibhausgasemissionen („THG“) , Luft- und Haushaltsverschmutzung und unsichere sanitäre Einrichtungen.
- **Soziale Merkmale:** Fortschritte bei den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, „SDGs“), Gesundheits- und Bildungsniveau, Qualität der Regulierung, politische Stabilität und Freiheiten, Gleichstellung der Geschlechter sowie Forschung und Entwicklung.

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für Unternehmensemittenten beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und Landnutzung, Kohlenstoffemissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Wasserstress, Schadstoffemissionen und Abfälle, Finanzierung von Umweltauswirkungen, CO₂-Fußabdruck von Produkten, Umweltpolitik, Umweltmanagementsystem, Programme zur Reduzierung von THG-Emissionen, umweltfreundliche Beschaffungspolitik und Programme für treibhausfreie Luftemissionen.
- **Soziale Merkmale:** Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Schutz der Privatsphäre und Datensicherheit, Produktsicherheit und -qualität, Sicherheit von Finanzprodukten, Diskriminierungspolitik, Programme zur Einbindung der Gemeinschaft, Diversitätsprogramme und Menschenrechtspolitik.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses haben der Manager und der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten den NB-ESG-Quotienten, um die aufgeführten ökologischen und sozialen Merkmale zu bewerben, indem sie primär in Wertpapiere von Emittenten mit einem relativ günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotienten-Rating investierten. Dementsprechend beschränkten der Manager und der Sub-Investment-Manager das Engagement in Emittenten mit dem schlechtesten NB-ESG-Quotienten-Rating, außer es bestand die begründete Erwartung, dass sich das NB-ESG-Quotienten-Rating im Laufe der Zeit verbessern würde.

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Bezugszeitraum | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|--------------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | 55 | 1-100 | 97 % |
| Daten von Dritten | 4,8 | 0-10 | |

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

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Das Portfolio baut sein Engagement in Kraftwerkskohle schrittweise ab und verbietet Investitionen in Wertpapiere von Emittenten, die mehr als 10 % ihrer Einnahmen aus dem Abbau von Kraftwerkskohle erzielten oder die neue Kohlekraftwerke ausbauten (wie durch interne Prüfungen festgestellt). Das Portfolio untersagte außerdem Investitionen in Emittenten aus der Kraftwerksindustrie, die mehr als 95 % ihrer installierten Kraftwerkskapazitäten aus Kraftwerkskohle bezogen, die in neue Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle expandierten oder deren Investitionsbudgets für Expansionszwecke keine Mindestschwelle für Investitionen in Nicht-Kohle enthielten (wie durch interne Prüfungen festgestellt). Die vom Portfolio gehaltenen Investitionen waren nicht in Wertpapieren von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstößend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen. Darüber hinaus schloss das Portfolio Wertpapiere von Emittenten aus, die 5 % oder mehr ihrer Umsätze aus der Herstellung von Tabakerzeugnissen erzielten. Emittenten, die an direkter Kinderarbeit beteiligt waren, und Emittenten, die mehr als 10 % der Umsätze aus der Ölsandgewinnung erzielten, wurden ebenfalls ausgeschlossen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstießen. Wo möglich haben der Manager und der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise ihrer Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager erörterten und diskutierten die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund ihres eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

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

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlage des Portfolios).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

| | NB-ESG-Quotient-Rating | Rating der Daten durch externe Anbieter | Kombinierte Abdeckung |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| Bereich | 1-100 | 0-10 | 0 %-100 % |
| Bezugszeitraum 2022 | 54 | 4,8 | 96 % |
| Bezugszeitraum 2023 | 55 | 4,8 | 97 % |

Die Bewertung des NB-ESG-Quotienten hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

Das Rating der Daten durch externe Anbieter blieb im Vergleich zum Vorjahr unverändert.

2. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

| | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|--------------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0 |
| Bezugszeitraum 2023 | 0 |

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten. Dessen ungeachtet waren der Manager und der Sub-Investment-Manager nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

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

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

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager und den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten in Bezug auf die Nachhaltigkeitsfaktoren die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 1 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für Unternehmensemittenten (die „**PAIs für Unternehmensemittenten**“), und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 2 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für staatliche Emittenten (die „**staatliche PAIs**“) (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“):

| Teil 1 – PAIs für Unternehmensemittenten | |
|---|--|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgas-emissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |
| Teil 2 – staatliche PAIs | |
| <i>Umwelt</i> | PAI 15 - THG-Emissionsintensität |
| <i>Soziales</i> | PAI 16 - Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager und den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|-------------------------------------|---|-------------------------|-----------------------|
| SOUTH AFRICA (REPUBLIC OF) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 2,5 % | Südafrika |
| MEX BONOS DE DESARROLLO | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 2,2 % | Mexiko |
| MEXICO (UNITED MEXICAN STATES) (GO) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 2,2 % | Mexiko |
| SOUTH AFRICA (REPUBLIC OF) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 2,1 % | Südafrika |
| COLOMBIA (REPUBLIC OF) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,7 % | Kolumbien |
| POLAND GOVERNMENT BOND | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,7 % | Polen |
| TITULOS DE TESORERIA B | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,7 % | Kolumbien |
| POLAND (REPUBLIC OF) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,6 % | Polen |
| INDONESIA (REPUBLIC OF) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,5 % | Indonesien |
| CZECH REPUBLIC RegS | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,5 % | Tschechische Republik |
| MALAYSIA GOVERNMENT | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,4 % | Malaysia |
| SOUTH AFRICA (REPUBLIC OF) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,4 % | Südafrika |
| INDONESIA (REPUBLIC OF) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,3 % | Indonesien |
| MEXICO (UNITED MEXICAN STATES) (GO) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,2 % | Mexiko |
| CZECH REPUBLIC RegS | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,2 % | Tschechische Republik |

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.



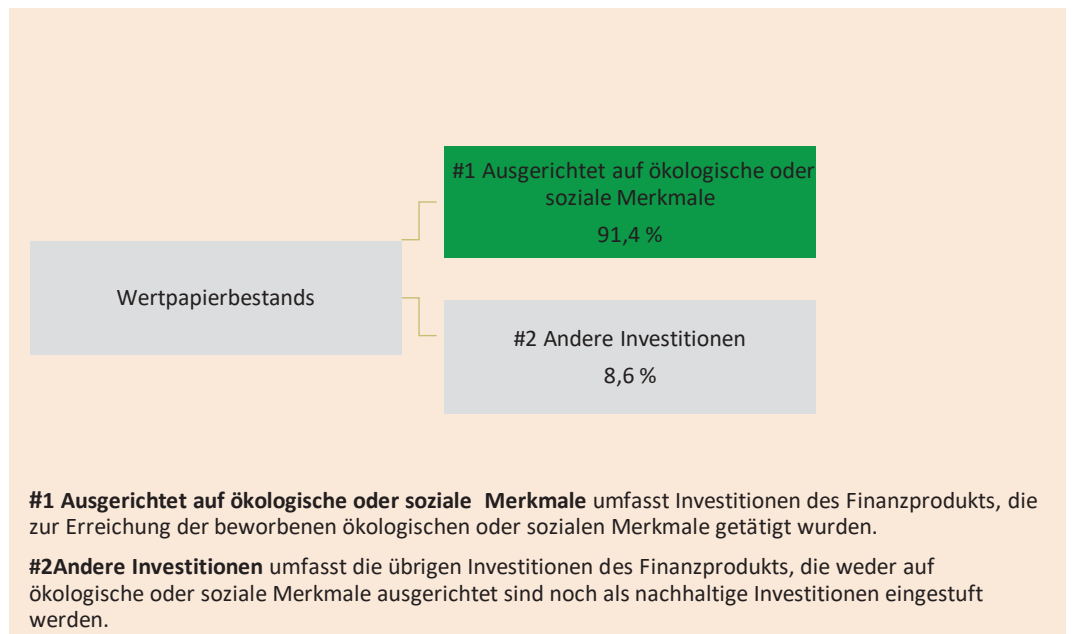
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 91,4 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 8,6 % an „sonstigen Investitionen“.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berechneten den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager und der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatten. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Bildung des Mittelwerts aus dem Durchschnitt der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



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

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Bildung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|--|-------------------------|
| C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 0,2 % |
| D – Energieversorgung | 2,1 % |
| F – Baugewerbe/Bau | 0,1 % |
| G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 0,1 % |
| H – Verkehr und Lagerei | 0,1 % |
| I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie | 0,0 % |
| J – Information und Kommunikation | 0,0 % |
| K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 3,7 % |
| N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 0,1 % |
| O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 92,4 % |
| R – Kunst, Unterhaltung und Erholung | 0,0 % |
| U – Exterritoriale Organisationen und Körperschaften | 0,4 % |
| Keine | 1,0 % |

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager können bestätigen, dass das Portfolio in Investitionen investiert hat, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager und der Sub-Investment-Manager werden das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

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

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

● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

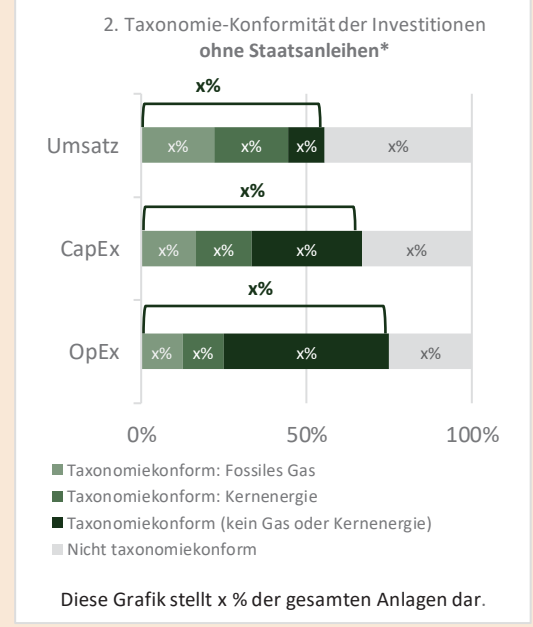
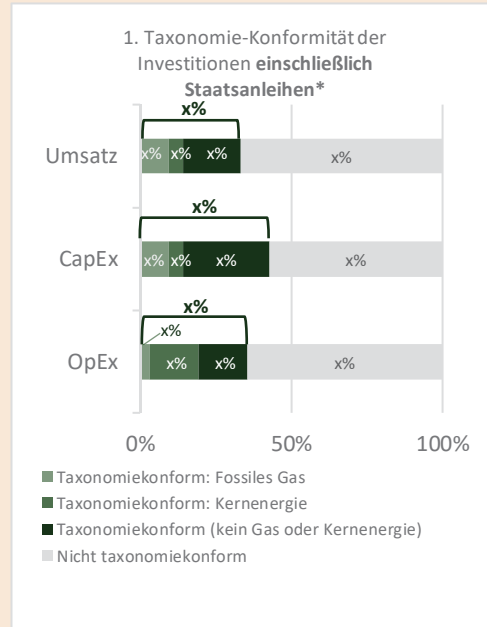
- Ja:
- In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

¹ Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



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

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager und der Sub-Investment-Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachteten, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen, verhinderten und sie sicherstellen, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager wendeten bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager verstehen unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Managers und des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers und des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager und vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager engagierten sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager betrachteten diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil ihres Anlageprozesses. Die Fortschritte bei der Einbindung wurden vom Manager und dem Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

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

k.A.

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

k.A.

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

k.A.

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

k.A.

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

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (das „Portfolio“)

Unternehmenskennung: 549300JASQ1JIDYO8X22

Ökologische und/oder soziale Merkmale

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

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

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

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

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

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

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

Nein

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

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

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

mit einem sozialen Ziel

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

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „Bezugszeitraum“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für staatliche Emittenten beworben:

- **Ökologische Merkmale:** staatliche Energieeffizienz, Anpassung an den Klimawandel, Entwaldung, Treibhausgasemissionen („THG“) , Luft- und Haushaltsverschmutzung und unsichere sanitäre Einrichtungen.
- **Soziale Merkmale:** Fortschritte bei den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, „SDGs“), Gesundheits- und Bildungsniveau, Qualität der Regulierung, politische Stabilität und Freiheiten, Gleichstellung der Geschlechter sowie Forschung und Entwicklung.

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für Unternehmensemittenten beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und Landnutzung, Kohlenstoffemissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Wasserstress, Schadstoffemissionen und Abfälle, Finanzierung von Umweltauswirkungen, CO₂-Fußabdruck von Produkten, Umweltpolitik, Umweltmanagementsystem, Programme zur Reduzierung von THG-Emissionen, umweltfreundliche Beschaffungspolitik und Programme für treibhausfreie Luftemissionen.
- **Soziale Merkmale:** Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Schutz der Privatsphäre und Datensicherheit, Produktsicherheit und -qualität, Sicherheit von Finanzprodukten, Diskriminierungspolitik, Programme zur Einbindung der Gemeinschaft, Diversitätsprogramme und Menschenrechtspolitik.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses haben der Manager und der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „NB- ESG-Quotient“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten den NB-ESG-Quotienten, um die aufgeführten ökologischen und sozialen Merkmale zu bewerben, indem sie primär in Wertpapiere von Emittenten mit einem relativ günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotienten-Rating investierten. Dementsprechend beschränkten der Manager und der Sub-Investment-Manager das Engagement in Emittenten mit dem schlechtesten NB-ESG-Quotienten-Rating, außer es bestand die begründete Erwartung, dass sich das NB-ESG-Quotienten-Rating im Laufe der Zeit verbessern würde.

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Bezugszeitraum | Rating | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|--------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | 55 | 97 % |
| Daten von Dritten | 4,7 | |

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

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Das Portfolio baut sein Engagement in Kraftwerkskohle schrittweise ab und verbietet Investitionen in Wertpapiere von Emittenten, die mehr als 10 % ihrer Einnahmen aus dem Abbau von Kraftwerkskohle erzielen oder die neue Kohlekraftwerke ausbauen (wie durch interne Prüfungen festgestellt). Das Portfolio untersagte außerdem Investitionen in Emittenten aus der Kraftwerksindustrie, die mehr als 95 % ihrer installierten Kraftwerkskapazitäten aus Kraftwerkskohle bezogen, die in neue Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle expandierten oder deren Investitionsbudgets für Expansionszwecke keine Mindestschwelle für Investitionen in Nicht-Kohle enthielten (wie durch interne Prüfungen festgestellt). Seit dem 6. Dezember 2023 schloss das Portfolio Unternehmen aus dem Anlageuniversum aus, die Brandwaffen unter Verwendung von weißem Phosphor herstellen oder einen Bezug zur Atomwaffenindustrie haben. Das Portfolio hat Wertpapiere von Unternehmen ausgeschlossen, die 5 % oder mehr ihrer Umsätze aus der Herstellung von Material für die Erwachsenenunterhaltung oder der Herstellung konventioneller Waffen erzielt haben. Das Portfolio investierte nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstößend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen. Darüber hinaus schloss das Portfolio Wertpapiere von Emittenten aus, die 5 % oder mehr ihrer Umsätze aus der Herstellung von Tabakerzeugnissen erzielen. Emittenten, die an direkter Kinderarbeit beteiligt waren, und Emittenten, die mehr als 10 % der Umsätze aus der Ölsandgewinnung erzielen, wurden ebenfalls ausgeschlossen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich haben der Manager und der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise ihrer Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager erörterten und diskutierten die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund ihres eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlage des Portfolios).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

| | NB-ESG-Quotient-Rating | Rating der Daten durch externe Anbieter | Kombinierte Abdeckung |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| Bereich | 1-100 | 0-10 | 0-100 % |
| Bezugszeitraum 2022 | 54 | 4,6 | 95 % |
| Bezugszeitraum 2023 | 55 | 4,7 | 97 % |

Die Bewertung des NB-ESG-Quotienten hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

Das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen sowie auf potenzielle Änderungen oder Unterschiede im externen Emittenten-Rating.

2. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

| | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|--------------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0 |
| Bezugszeitraum 2023 | 0 |

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten. Dessen ungeachtet waren der Manager und der Sub-Investment-Manager nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

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

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

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager und den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten in Bezug auf die Nachhaltigkeitsfaktoren die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 1 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für Unternehmensemittenten (die „**PAIs für Unternehmensemittenten**“), und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 2 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für staatliche Emittenten (die „**staatliche PAIs**“) (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“):

| Teil 1 – PAIs für Unternehmensemittenten | |
|---|--|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgasemissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |
| Teil 2 – staatliche PAIs | |
| <i>Umwelt</i> | PAI 15 - THG-Emissionsintensität |
| <i>Soziales</i> | PAI 16 - Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager und den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|--|---|-------------------------|-----------------------|
| SOUTH AFRICA (REPUBLIC OF) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,5 % | Südafrika |
| TITULOS DE TESORERIA B | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,5 % | Kolumbien |
| MEXICO (UNITED MEXICAN STATES) (GO | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,2 % | Mexiko |
| SOUTH AFRICA (REPUBLIC OF) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,0 % | Südafrika |
| POLAND GOVERNMENT BOND | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,0 % | Polen |
| MEX BONOS DE DESARROLLO | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,0 % | Mexiko |
| INDONESIA (REPUBLIC OF) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,0 % | Indonesien |
| THAILAND KINGDOM OF (GOVERNMENT) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 0,9 % | Thailand |
| SOUTH AFRICA (REPUBLIC OF) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 0,8 % | Südafrika |
| COLOMBIA (REPUBLIC OF) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 0,7 % | Kolumbien |
| FONDO MIVIVIENDA SA RegS | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 0,7 % | Peru |
| EMPRESAS PUBLICAS DE MEDELLIN ESP RegS | D – Energieversorgung | 0,7 % | Kolumbien |
| POLAND (REPUBLIC OF) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 0,7 % | Polen |
| CZECH REPUBLIC RegS | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 0,7 % | Tschechische Republik |
| INDONESIA (REPUBLIC OF) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 0,7 % | Indonesien |

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

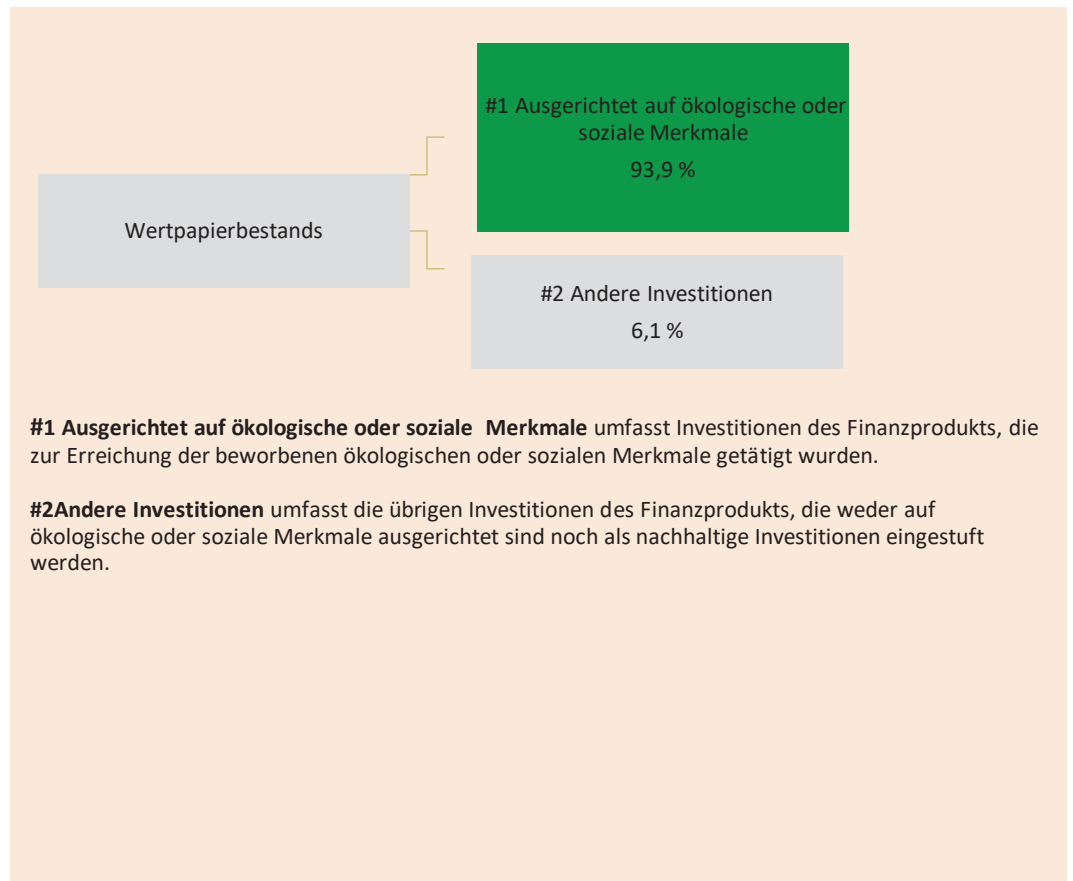
Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 93,9 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 6,1 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berechneten den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager und der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatten. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



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

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|--|-------------------------|
| B – Bergbau und Steine & Erden | 4,9 % |
| C – Fertigung | 3,7 % |
| D – Energieversorgung | 4,2 % |
| F – Baugewerbe/Bau | 0,4 % |
| G – Handel, Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 0,8 % |
| H – Transport und Lagerung | 1,5 % |
| I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie | 0,3 % |
| J – Information und Kommunikation | 1,3 % |
| K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 15,4 % |
| L – Immobilienaktivitäten | 0,2 % |
| M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Tätigkeiten | 0,1 % |
| N – Verwaltungs- und Unterstützungsdienstleistungen | 0,5 % |
| O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung | 64,6 % |
| R – Kunst, Unterhaltung und Erholung | 0,6 % |
| U – Exterritoriale Organisationen und Körperschaften | 0,5 % |
| Keine | 1,0 % |

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

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

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine 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?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager können bestätigen, dass das Portfolio in Investitionen investiert hat, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager und der Sub-Investment-Manager werden das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

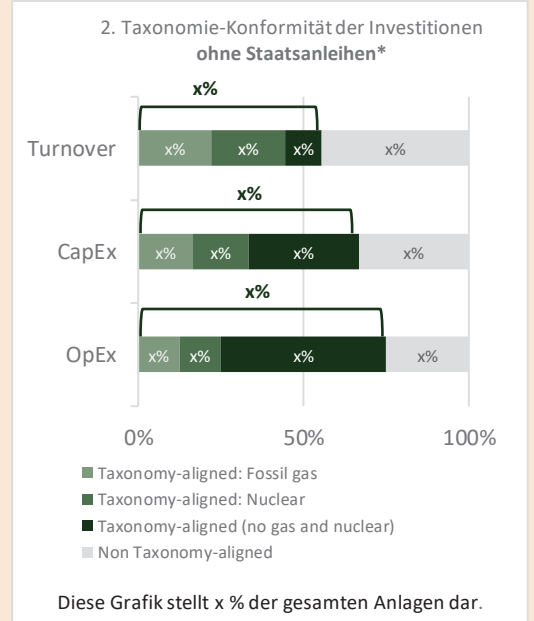
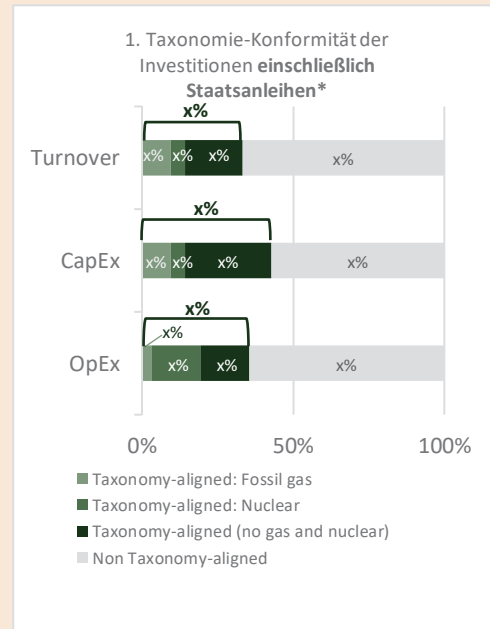
- Ja:
 In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

¹ Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



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

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager und der Sub-Investment-Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachteten, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen, verhinderten und sie sicherstellen, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager wendeten bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager verstehen unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Managers und des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers und des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager und vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in seine internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager engagierten sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager betrachteten diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil ihres Anlageprozesses. Die Fortschritte bei der Einbindung wurden vom Manager und dem Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

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

k.A.

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

k.A.

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

k.A.

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

k.A.

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

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend (das „Portfolio“).

Unternehmenskennung: 549300IFJK0FPOE1X496

Ökologische und/oder soziale Merkmale

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

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

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

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

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

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

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

Nein

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 58.6 %* an nachhaltigen Investitionen.

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

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

mit einem sozialen Ziel

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

*Weitere Einzelheiten zum Mindestanteil nachhaltiger Investitionen, die ökologische oder soziale Merkmale bewerben, finden Sie unter der Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“.

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „Bezugszeitraum“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben zudem die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung dieser ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für staatliche Emittenten beworben:

- **Ökologische Merkmale:** staatliche Energieeffizienz, Anpassung an den Klimawandel, Entwaldung, Treibhausgasemissionen („THG“) , Luft- und Haushaltsverschmutzung und unsichere sanitäre Einrichtungen.
- **Soziale Merkmale:** Fortschritte bei der Verwirklichung der UN-Ziele einer nachhaltigen Entwicklung (Sustainable Development Goals, „SDGs“), Gesundheits- und Bildungsniveau, Qualität der Regulierung, politische Stabilität und Freiheiten, Gleichstellung der Geschlechter sowie Forschung und Entwicklung.

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für Unternehmensemittenten beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und Landnutzung, Kohlenstoffemissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Wasserstress, Schadstoffemissionen und Abfälle, Finanzierung von Umweltauswirkungen, CO₂-Fußabdruck von Produkten, Umweltpolitik, Umweltmanagementsystem, Programme zur Reduzierung von THG-Emissionen, umweltfreundliche Beschaffungspolitik und Programme für treibhausfreie Luftemissionen.
- **Soziale Merkmale:** Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Schutz der Privatsphäre und Datensicherheit, Produktsicherheit und -qualität, Sicherheit von Finanzprodukten, Diskriminierungspolitik, Programme zur Einbindung der Gemeinschaft, Diversitätsprogramme und Menschenrechtspolitik.

In dem Bestreben, das Portfolio auf ein Netto-Null-Ziel auszurichten, beworben und bewerben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Verringerung des CO₂-Fußabdrucks des Portfolios in Bezug auf Scope-1-, Scope-2- und wesentliche Scope-3-THG-Emissionen.¹ Es existiert kein jährliches Reduktionsziel. Stattdessen wird sich auf das Zwischenziel 2030 und das Netto-Null-Ziel 2050 konzentriert.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

¹Scope-1-Emissionen sind direkte Emissionen aus Quellen, die sich im Besitz des Emittenten befinden oder von ihm kontrolliert werden (z. B. Emissionen, die sich direkt durch die Geschäftsprozesse des Emittenten oder durch Fahrzeuge im Besitz des Emittenten ergeben). Scope-2-Emissionen sind indirekte Emissionen aus der Erzeugung von Strom, Dampf, Wärme und Kälte, die vom Emittenten verbraucht wurden. Scope-3-Emissionen sind alle anderen indirekten Emissionen, die in der Wertschöpfungskette eines Emittenten anfallen (u. a. Emissionen aus den vom Emittenten verbrauchten Produkten oder Dienstleistungen, aus der Entsorgung seiner Abfälle, aus dem Pendelverkehr seiner Mitarbeiter, aus dem Vertrieb und Transport seiner Produkte oder aus seinen Investitionen).

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

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Im Rahmen des Anlageprozesses haben der Manager und der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten den NB-ESG-Quotienten, um die aufgeführten ökologischen und sozialen Merkmale zu bewerten, indem sie primär in Wertpapiere von Emittenten mit einem relativ günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotienten-Rating investierten. Das Portfolio hat nicht in Emittenten investiert, die im Hinblick auf den NB-ESG-Quotienten im unteren Quartil rangieren und bei denen keine Aussicht auf kurzfristige Verbesserungen besteht.

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Bezugszeitraum | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|--------------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | 57 | 1-100 | 99 % |
| Daten von Dritten | 4,8 | 0-10 | |

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy und die Neuberger Berman Enhanced Sustainable Exclusion Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar

waren. Seit dem 6. Dezember 2023 schloss das Portfolio Unternehmen aus dem Anlageuniversum aus, die Brandwaffen unter Verwendung von weißem Phosphor herstellten oder einen Bezug zur Atomwaffenindustrie haben. Das Portfolio hat Wertpapiere von Unternehmen ausgeschlossen, die 5 % oder mehr ihrer Umsätze aus der Herstellung von Material für die Erwachsenenunterhaltung oder der Herstellung konventioneller Waffen erzielt haben. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen. Darüber hinaus schloss das Portfolio Emittenten aus dem Anlageuniversum aus, die in der Pelzherstellung, im Glücksspiel oder im Bereich Kernkraft tätig sind. Seit dem 2. August 2023 haben weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager Investitionen in Schuldtiteln noch in Geldmarktinstrumente von staatlichen Emittenten und/oder in Unternehmen getätigt, bei denen der Manager und der Sub-Investment-Manager eine schwache ESG-Praxis festgestellt haben. Diese Ausschlüsse basierten auf einer Reihe von ESG-Kriterien, darunter:

- Staatliche Emittenten, die auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten im untersten Dezil rangierten und bei denen keine Aussicht auf kurzfristige Verbesserungen bestanden; oder
- Staatliche Emittenten, die aufgrund von ESG-Erwägungen aus dem J.P. Morgan ESG EMBI Global Diversified Index (Total Return, USD) ausgeschlossen wurden; oder
- staatliche Emittenten, deren führende Vertreter vom UN-Sicherheitsrat aufgrund von Menschenrechtsverletzungen mit Sanktionen belegt wurden; oder
- Staatliche Emittenten, bei denen eine hohe und steigende THG-Emissionsintensität festgestellt wurde; oder
- Staatliche Emittenten, bei denen schlechte und sich verschlechternde Kennzahlen für Menschenrechte und Rechtsstaatlichkeit festgestellt wurden; oder
- staatliche Emittenten, die den vom Global Forum on Transparency and Exchange of Information for Tax Purposes der OECD aufgestellten Standard nicht einhielten, oder staatliche Emittenten, die von der Financial Action Task Force („FATF“) als Hochrisikoland eingestuft wurden.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich haben der Manager und der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise ihrer Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager erörterten und diskutierten die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund ihres eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. Der NB-ESG-Quotient

| | NB-ESG-Quotient-Rating | Rating der Daten durch externe Anbieter | Kombinierte Abdeckung |
|----------------------------|------------------------|---|-----------------------|
| Bereich | 1-100 | 0-10 | 0-100 % |
| Bezugszeitraum 2022 | 56 | 4,8 | 97 % |
| Bezugszeitraum 2023 | 57 | 4,8 | 99 % |

Das NB-ESG-Quotient-Rating hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert, und das Rating der Daten externer Anbieter ist unverändert geblieben. Dies ist auf Verbesserungen bei im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen sowie auf Unterschiede im externen Emittenten-Rating.

2. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

| | Gesamtzahl der Verstöße |
|---------------------|-------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0 |
| Bezugszeitraum 2023 | 0 |

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

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckt sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Investition zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Investition eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat (wie nachstehend erläutert) und (iii) eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die Unternehmensführung eines Emittenten, um festzustellen, ob der Emittent einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griffen der Manager und der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die wirtschaftlichen Tätigkeiten eines Emittenten auf ökologische oder soziale Merkmalen ausgerichtet waren.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager überprüften die Emittenten auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Emittenten diese Prüfung bestanden haben, haben der Manager und der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag des Emittenten zur Wirtschaft gemessen.

Bei Unternehmensemittenten haben der Manager und der Sub-Investment-Manager dies auf zwei Arten erfasst:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen („SDGs“).

Die Berücksichtigung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs, nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers, war durch die Verfügbarkeit von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griffen der Manager und der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Stellvertreterdaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

Bei staatlichen Emittenten haben der Manager und der Sub-Investment-Manager dies auf folgenden Arten erfasst:

- Fortschritte bei der Anpassung an den Klimawandel und dem Klimaschutz und
- Fortschritte bei der Erreichung der SDGs, mit Schwerpunkt auf Lebenserwartung und Bildung

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

Der Manager und der Sub-Investment-Manager wandten ihren Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigen. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachteten der Manager und der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Bei der Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Anlagen kein ökologisches oder soziales nachhaltiges Anlageziel erheblich beeinträchtigten, berücksichtigten der Manager und der Sub-Investment-Manager die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „**PAIs**“) und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen für staatliche Emittenten (wie nachfolgend in Teil 2 der Tabelle im Abschnitt „*Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*“ dargelegt) (die „**staatlichen PAIs**“):

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

| PAIs | |
|-------------------------------|--|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgasemissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind PAI 5 - Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren |
| <i>Biodiversität</i> | PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken |
| <i>Wasser</i> | PAI 8 - Emissionen in Wasser |
| <i>Abfall</i> | PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle |

| | |
|-----------------------------------|--|
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | <p>PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen</p> <p>PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen</p> <p>PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle</p> <p>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen</p> <p>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)</p> |
|-----------------------------------|--|

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager investierten nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Manager und den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Emittenten, die quantitative und qualitative Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden, unterschreiten;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Emittenten, wenn sie unter die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

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

Der Manager und der Sub-Investment-Manager investierten nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

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

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

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

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager und den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

- I. Wie oben unter „Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs und staatlichen PAIs berücksichtigt.
- II. Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten in Bezug auf die Nachhaltigkeitsfaktoren die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 1 der nachstehenden Tabelle für Unternehmensemittenten (die „**PAIs für Unternehmensemittenten**“), und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 2 der nachstehenden Tabelle für staatliche Emittenten (die „**staatliche PAIs**“) (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“) aufgeführt sind:

| Teil 1 – PAIs für Unternehmensemittenten | |
|--|---|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| Treibhausgasemissionen | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |

| | |
|-----------------------------------|--|
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |
| Teil 2 – staatliche PAIs | |
| <i>Umwelt</i> | PAI 15 - THG-Emissionsintensität |
| <i>Soziales</i> | PAI 16 - Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbareren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager und den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|--|---|-------------------------|------------|
| THAILAND KINGDOM OF (GOVERNMENT) | O – Öffentliche Sozialversicherung* Verwaltung, Verteidigung, | 1,1 % | Thailand |
| CHINA PEOPLES REPUBLIC OF (GOVERNMENT) | O – Öffentliche Sozialversicherung* Verwaltung, Verteidigung, | 1,1 % | China |
| CHINA PEOPLES REPUBLIC OF (GOVERNMENT) | O – Öffentliche Sozialversicherung* Verwaltung, Verteidigung, | 0,9 % | China |
| MEXICO (UNITED MEXICAN STATES) (GO) | O – Öffentliche Sozialversicherung* Verwaltung, Verteidigung, | 0,8 % | Mexiko |
| INDONESIA REPUBLIC OF | O – Öffentliche Sozialversicherung* Verwaltung, Verteidigung, | 0,8 % | Indonesien |
| INDONESIA (REPUBLIC OF) | O – Öffentliche Sozialversicherung* Verwaltung, Verteidigung, | 0,8 % | Indonesien |
| MEXICO (UNITED MEXICAN STATES) | O – Öffentliche Sozialversicherung* Verwaltung, Verteidigung, | 0,7 % | Mexiko |
| ROMANIA (REPUBLIC OF) RegS | O – Öffentliche Sozialversicherung* Verwaltung, Verteidigung, | 0,7 % | Rumänien |
| PANAMA (REPUBLIC OF) | O – Öffentliche Sozialversicherung* Verwaltung, Verteidigung, | 0,6 % | Panama |
| PERU THE REPUBLIC OF | O – Öffentliche Sozialversicherung* Verwaltung, Verteidigung, | 0,6 % | Peru |
| MALAYSIA GOVERNMENT | O – Öffentliche Sozialversicherung* Verwaltung, Verteidigung, | 0,6 % | Malaysia |
| INDONESIA (REPUBLIC OF) RegS | O – Öffentliche Sozialversicherung* Verwaltung, Verteidigung, | 0,6 % | Indonesien |
| MEX BONOS DE DESARROLLO | O – Öffentliche Sozialversicherung* Verwaltung, Verteidigung, | 0,6 % | Mexiko |
| UNITED MEXICAN STATES | O – Öffentliche Sozialversicherung* Verwaltung, Verteidigung, | 0,6 % | Mexiko |
| KAZAKHSTAN GOVERNMENT BOND MTN RegS | O – Öffentliche Sozialversicherung* Verwaltung, Verteidigung, | 0,6 % | Kasachstan |

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.



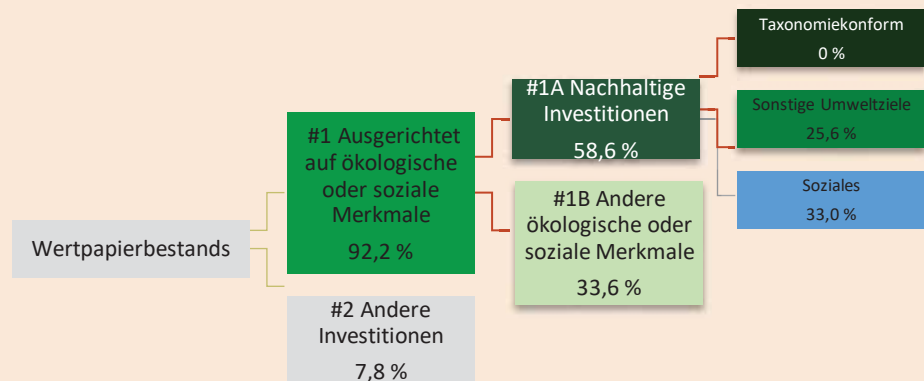
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 92,2 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio verpflichtete sich, mindestens 50 % nachhaltige Investitionen zu halten. Während des Bezugszeitraums 2023 hielt das Portfolio 58,6 % an nachhaltigen Investitionen.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 7,8 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berechneten den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager und der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatten. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder Dritten beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



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

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

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.

- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

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

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|---|-------------------------|
| B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden | 1,5 % |
| C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,3 % |
| D – Energieversorgung | 0,4 % |
| G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 0,7 % |
| H - Verkehr und Lagerei | 1,2 % |
| J – Information und Kommunikation | 1,1 % |
| K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 8,3 % |
| O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 82,1 % |
| U – Exterritoriale Organisationen und Körperschaften | 2,0 % |
| Keine | 0,4 % |

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

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

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine 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?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager können bestätigen, dass das Portfolio in Investitionen investiert hat, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager und der Sub-Investment-Manager werden das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessert.

● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert²?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

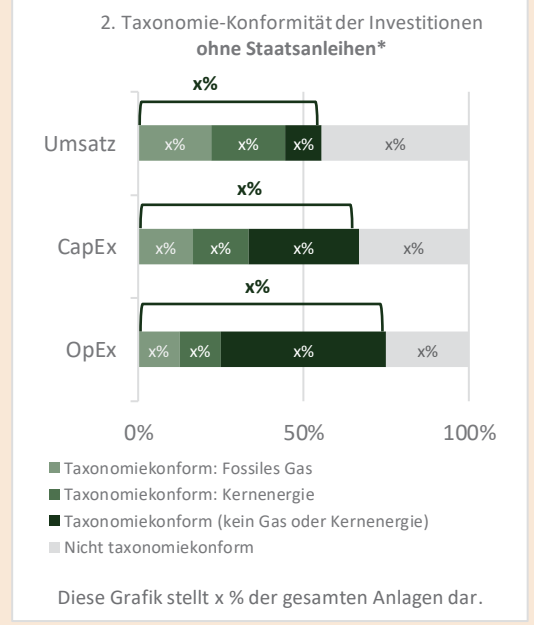
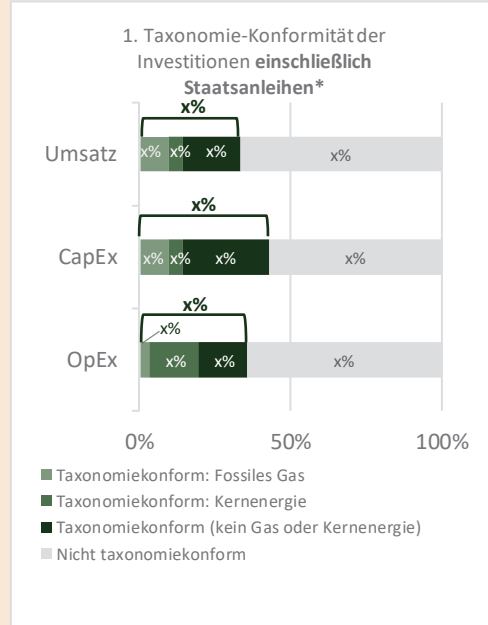
Nein

² Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



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

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Das Portfolio hielt 25,6 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, das nicht mit der EU-Taxonomie konform ist.



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?

Das Portfolio hielt 33,0 % an sozial nachhaltigen Investitionen.



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

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager und der Sub-Investment-Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachteten, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen, verhinderten und sie sicherstellen, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager wendeten bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager verstehen unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Managers und des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers und des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager und vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager engagierten sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager betrachteten diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil ihres Anlageprozesses. Die Fortschritte bei der Einbindung wurden vom Manager und dem Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
k.A.

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

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund (das „Portfolio“)

Unternehmenskennung: 549300XPW2SIPQYGFT52

Ökologische und/oder soziale Merkmale

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

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

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

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

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

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

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

Nein

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

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

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

mit einem sozialen Ziel

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

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „Bezugszeitraum“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

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



Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Luftqualität, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zur Gesundheitsversorgung, Datenschutz und -sicherheit, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsstandards in den Lieferketten.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

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

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**NB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor in den Schwellenländern angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteten ESG-Daten erstellt. Ergänzend kamen interne qualitative Analysen hinzu, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen in Schwellenländern im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Durch die Integration lokaler Erkenntnisse in die globale Wesentlichkeitsmatrix von NB nutzte der Sub-Investment-Manager die globale Wesentlichkeitsmatrix von NB und passte die wesentlichen ESG-Merkmale an, um sicherzustellen, dass sie den Schwellenländern Rechnung trugen. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB berücksichtigte die langfristigen ESG-Merkmale umfassend, welche die Entwicklung der Branchen und Unternehmen in den Schwellenländern betrafen, und identifizierte Unternehmen, die in den Schwellenländern als Werttreiber fungierten.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Unternehmen mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Unternehmen mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Unternehmen diesbezüglich keine Maßnahmen ergriff, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt.

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Bezugszeitraum | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|-----------------|-------------------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | ES: B G: 2,7 | ES: A-D G: 1-4 | 90 % |
| Daten von Dritten | 5,9 | 0-10 | |

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale („ES“) werden die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („G“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („CVaR“) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und der Chancen durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 29,6 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 90 %, was einem Durchschnitt der CVaR-Abdeckung über die vier Kalenderquartalsenden hinweg entspricht.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstießen oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstößend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstießen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

| | NB-ESG-Quotient-Rating | Rating der Daten durch externe Anbieter | Kombinierte Abdeckung |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| Bereich | ES: A-D G: 1-4 | 0-10 | 0-100 % |
| Bezugszeitraum 2022 | ES: B G: 2,0 | 5,6 | 95 % |
| Bezugszeitraum 2023 | ES: B G: 2,7 | 5,9 | 90 % |

Das ES-Rating des NB-ESG-Quotienten ist im Vergleich zum Vorjahr unverändert geblieben, das G-Rating des NB-ESG-Quotienten hat sich verschlechtert und das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich verbessert. Dies ist unter Umständen auf Verbesserungen bei den einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmen gemäß externem Datenanbieter oder auf Differenzen des von dem Anbieter bereitgestellten externen Rating des Unternehmens zurückzuführen.

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die kombinierte Abdeckung des NB-ESG-Quotienten und des externen Ratings aufgrund von Veränderungen bei den gehaltenen Unternehmen und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verlagert.

2. CVaR

| | CVaR | Abdeckung |
|----------------------------|-------------|------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | -28,8 % | 91 % |
| Bezugszeitraum 2023 | -29,6 % | 90 % |

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die CVaR-Prognose aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmen und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verändert.

3. Ausschlüsse

| | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|--------------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0 |
| Bezugszeitraum 2023 | 0 |

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

k.A.

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

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten. Dessen ungeachtet war der Sub-Investment-Manager nicht in Unternehmen investiert, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

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

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

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

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



Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| PAIs auf Produktebene | |
|-----------------------------------|--|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgas-emissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|------------------------------------|--|-------------------------|-------------------------|
| TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 8,1 % | Taiwan (Republik China) |
| SAMSUNG ELECTRONICS LTD | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 5,8 % | Republik Korea |
| TENCENT HOLDINGS LTD | J – Information und Kommunikation | 5,0 % | China |
| ALIBABA GROUP HOLDING LTD | G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 3,5 % | China |
| ICICI BANK LTD | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 2,2 % | Indien |
| SK HYNIX INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,1 % | Republik Korea |
| RELIANCE INDUSTRIES LTD | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 1,5 % | Indien |
| INDUSIND BANK LTD | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 1,5 % | Indien |
| HDFC BANK LTD | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 1,4 % | Indien |
| UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP | G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 1,3 % | Taiwan (Republik China) |
| APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD | Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen | 1,2 % | Indien |
| LG CHEM LTD | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 1,2 % | Republik Korea |
| BID CORPORATION LTD | I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie | 1,2 % | Südafrika |
| RIO TINTO PLC | B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden | 1,2 % | Australien |
| PETROLEO BRASILEIRO PREF SA | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 1,1 % | Brasilien |



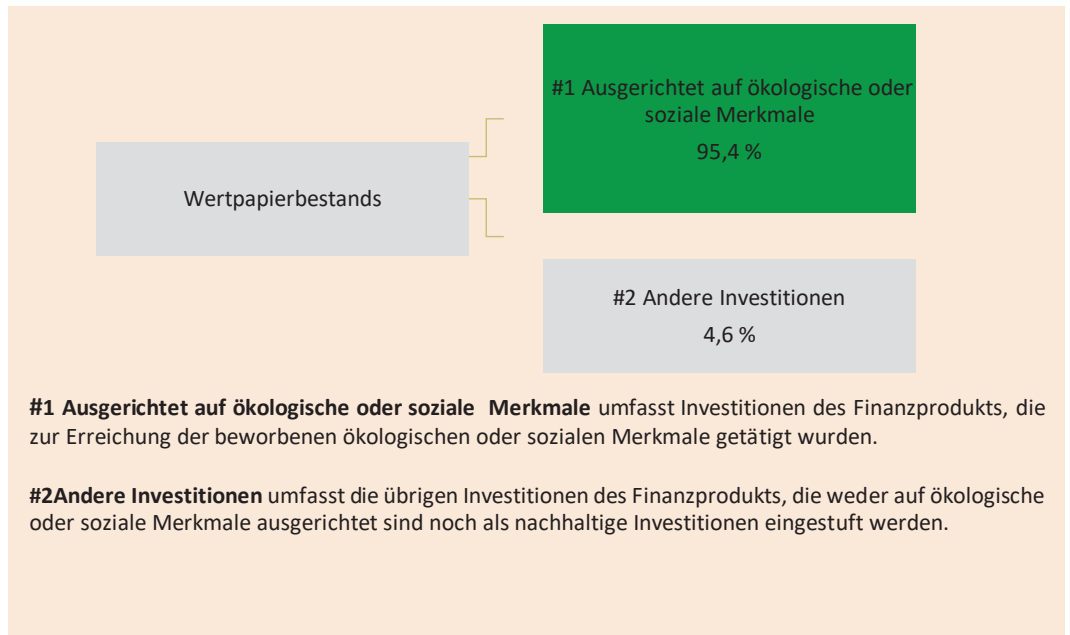
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 95,4 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 4,6 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



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

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|---|-------------------------|
| B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden | 4,7 % |
| C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 42,2 % |
| D – Energieversorgung | 0,4 % |
| F – Baugewerbe/Bau | 1,4 % |
| G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 10,1 % |
| H – Verkehr und Lagerei | 0,8 % |
| I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie | 2,6 % |
| J – Information und Kommunikation | 9,4 % |
| K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 22,9 % |
| L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 0,3 % |
| M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen | 0,9 % |
| N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 1,1 % |
| Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen | 1,8 % |
| R – Kunst, Unterhaltung und Erholung | 0,4 % |
| Keine | 0,9 % |



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

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

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

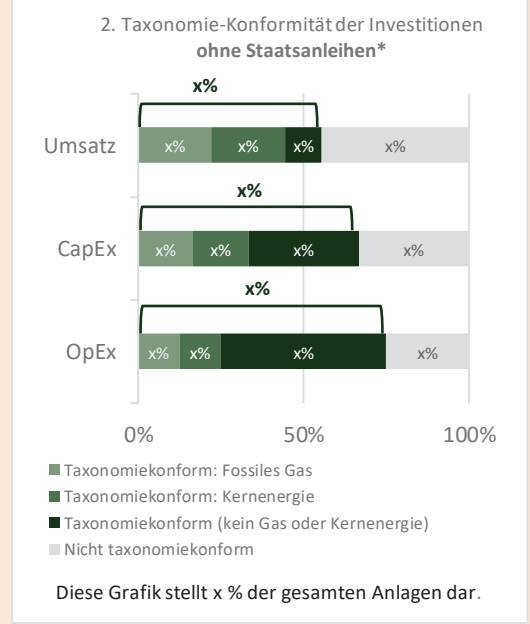
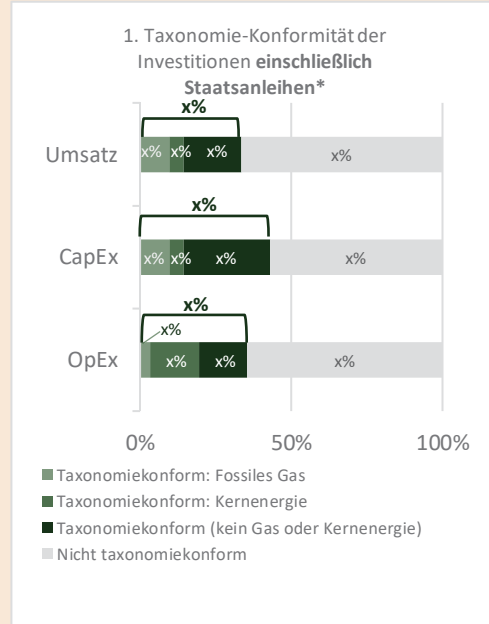
- Ja:
- In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

¹ Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



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

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde herangezogen, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die Gesamtbetrachtung der Unternehmen bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses.

Um die Beziehungen zu den Unternehmen aufrechtzuerhalten und zu verbessern und sicherzustellen, dass die Unternehmen ihren ESG-Kurs verfolgten, führte der Sub-Investment-Manager mit den Unternehmen einen aktiven Dialog, unabhängig davon, ob sie Kontroversen mit großen Auswirkungen oder ein schlechtes NB ESG-Quotient-Rating aufwiesen oder nicht. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
k.A.

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

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Euro Bond Fund (das „Portfolio“)*

Unternehmenskennung: 549300TQ5M6FBE2H8T74

Ökologische und/oder soziale Merkmale

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

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

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

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

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

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

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

Nein

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

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

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

mit einem sozialen Ziel

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

*Mit Wirkung vom 6. Dezember 2023 änderte der Neuberger Berman Euro Opportunistic Bond Fund seinen Namen in Neuberger Berman Euro Bond Fund.

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „Bezugszeitraum“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO₂-Fußabdrucks, Umweltmanagement, Treibhausgasemissionen („**THG**“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, Gelegenheiten für erneuerbare Energien, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikoübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen in der Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigte der Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**MB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sekorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistenteam für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergriffen hat, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühte sich der Manager, konstruktiven Dialogen bei Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

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

| Bezugszeitraum | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | 65 | 1-100 | 95 % |
| Daten von Dritten | 6,3 | 0-10 | |

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet. Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmensemittenten gemessen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und Chancen durch den Klimawandel pro Emission und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit eine Emission durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 3,1 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt

für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 16 %, was einem Durchschnitt der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale entspricht.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Außerdem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen. Ferner durften für das Portfolio keine Wertpapiere von Emittenten gekauft werden, die an der Herstellung von Tabakprodukten wie Zigarren, Zigaretten, E-Zigaretten, rauchfreiem Tabak, auflösbarem Tabak und Kautabak beteiligt waren. Dies schloss auch Emittenten ein, die Rohtabakblätter anbauen oder verarbeiten.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlage des Portfolios).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

| | NB-ESG-Quotient-Rating | Rating der Daten durch externe Anbieter | Kombinierte Abdeckung |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| Bereich | 1-100 | 0-10 | 0-100 % |
| Bezugszeitraum 2022 | 66 | 6,0 | 90 % |
| Bezugszeitraum 2023 | 65 | 6,3 | 95 % |

Das NB-ESG-Quotient-Rating hat sich im Vergleich zum Vorjahr verschlechtert, und das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich verbessert. Dies ist unter Umständen auf eine Verbesserung bei den einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten gemäß externem Datenanbieter oder auf Differenzen im von dem Anbieter bereitgestellten externen Rating des Emittenten zurückzuführen.

2. CVaR

| | CVaR | Abdeckung |
|----------------------------|-------------|------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | -5,4 % | 12 % |
| Bezugszeitraum 2023 | -3,1 % | 16 % |

Der durch die CVaR prognostizierte Verlust hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmensemittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

| | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|--------------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0 |
| Bezugszeitraum 2023 | 0 |

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Manager nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

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

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

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

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager) berücksichtigt.

Der Manager berücksichtigte in Bezug auf die Nachhaltigkeitsfaktoren die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 1 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für Unternehmensemittenten (die „**PAIs für Unternehmensemittenten**“), und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 2 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für staatliche Emittenten (die „**staatliche PAIs**“) (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“):

| Teil 1 – PAIs für Unternehmensemittenten | |
|---|--|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgas-emissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |
| Teil 2 – staatliche PAIs | |
| <i>Umwelt</i> | PAI 15 - THG-Emissionsintensität |
| <i>Soziales</i> | PAI 16 - Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel, die vom Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|--|---|-------------------------|---------------|
| PORTUGAL (REPUBLIC OF) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 2,59 % | Portugal |
| NETHERLANDS (KINGDOM OF) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,83 % | Niederlande |
| ITALY (REPUBLIC OF) RegS | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,69 % | Italien |
| GERMANY (FEDERAL REPUBLIC OF) RegS | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,66 % | Deutschland |
| FRANCE (REPUBLIC OF) RegS | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,42 % | Frankreich |
| ITALY (REPUBLIC OF) RegS | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,31 % | Italien |
| ITALY (REPUBLIC OF) RegS | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,23 % | Italien |
| ITALY (REPUBLIC OF) RegS | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,22 % | Italien |
| AMCO ASSET MANAGEMENT COMPANY SPA RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 1,14 % | Italien |
| EUROPEAN UNION RegS | U – Exterritoriale Organisationen und Körperschaften | 1,09 % | Supranational |
| SOUTHERN ELECTRIC GENERATING CO | D – Energieversorgung | 1,07 % | USA |
| TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NETHER | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 1,06 % | Israel |
| GLOBAL PAYMENTS INC | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 1,03 % | USA |
| EUROPEAN UNION RegS | U – Exterritoriale Organisationen und Körperschaften | 1,02 % | Supranational |
| BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO MTN RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 1,02 % | Polen |

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.



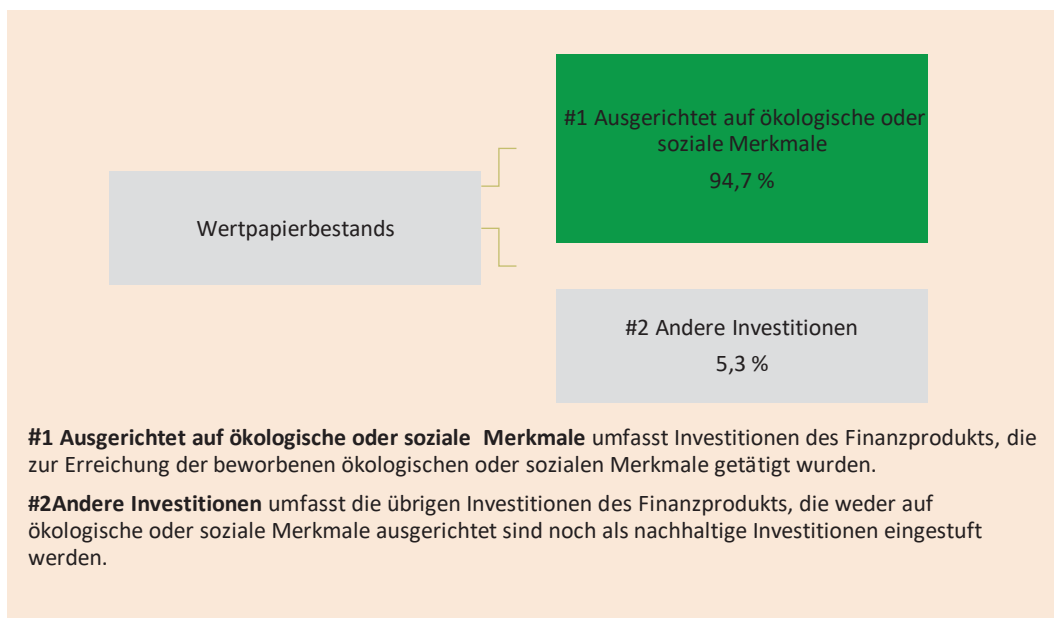
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 94,7 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 5,3 % an „sonstigen Investitionen“.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Der Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|---|-------------------------|
| B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden | 0,2 % |
| C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 1,8 % |
| D – Energieversorgung | 4,5 % |
| G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 0,8 % |
| J – Information und Kommunikation | 1,6 % |
| K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 33,7 % |
| L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 5,3 % |
| M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen | 0,3 % |
| N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 1,0 % |
| O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 41,8 % |
| R – Kunst, Unterhaltung und Erholung | 1,3 % |
| U – Extraterritoriale Organisationen und Körperschaften | 6,8 % |
| Keine | 0,9 % |

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

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

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

● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

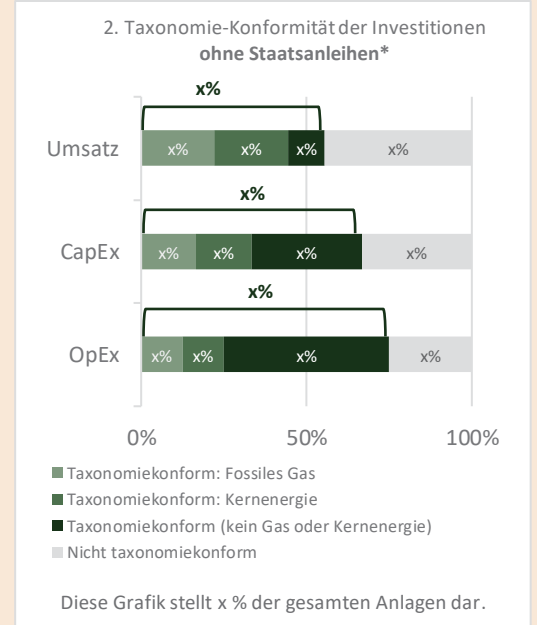
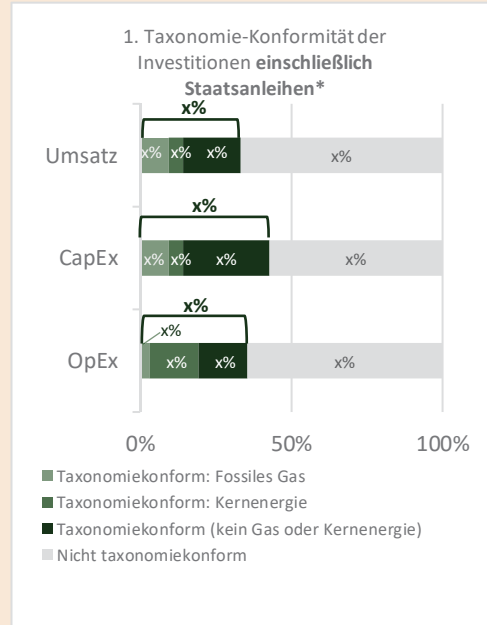
- Ja:
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

¹ Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



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

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder zur Gewährleistung einer adäquaten Liquidität, Absicherung und Besicherung.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittentenanalysen durch die Investmentteams des Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in seine internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Manager arbeitete mit den Emittenten über ein solides ESG-Dialogprogramm zusammen. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung der Mitwirkung verfolgt.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
k.A.

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

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund (das „Portfolio“)

Unternehmenskennung: 549300ZPJNN43P39QR29

Ökologische und/oder soziale Merkmale

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

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

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

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

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

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

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

Nein

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

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

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

mit einem sozialen Ziel

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

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [here](#).

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO₂-Fußabdrucks, Umweltmanagement, Treibhausgasemissionen („**THG**“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, Gelegenheiten für erneuerbare Energien, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikoübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen in der Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigte der Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**MB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistenteam für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergriffen hat, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühte sich der Manager, konstruktiven Dialogen bei Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

| Bezugszeitraum | Rating | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|--------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | 65 | 97 % |
| Daten von Dritten | 6,8 | |

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

Der Bezugszeitraum ist ein Durchschnitt der vier Kalenderquartalsenden.

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmensemittenten gemessen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und Chancen durch den Klimawandel pro Emission und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit eine Emission durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 5,4 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 21 %, was einem Durchschnitt der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale entspricht.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen. Ferner durften für das Portfolio keine Wertpapiere von Emittenten gekauft werden, die an der Herstellung von Tabakprodukten wie Zigarren, Zigaretten, E-Zigaretten, rauchfreiem Tabak, auflösbarem Tabak und Kautabak beteiligt waren. Dies schloss auch Emittenten ein, die Rohtabakblätter anbauen oder verarbeiten.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlage des Portfolios).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

| | NB-ESG-Quotient-Rating | Rating der Daten durch externe Anbieter | Kombinierte Abdeckung |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| Bereich | 1-100 | 0-10 | 0-100 % |
| Bezugszeitraum 2022 | 66 | 6,5 | 94 % |
| Bezugszeitraum 2023 | 65 | 6,8 | 97 % |

Das NB-ESG-Quotient-Rating hat sich im Vergleich zum Vorjahr verschlechtert, und das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich verbessert. Dies ist unter Umständen auf eine Verbesserung bei den einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten gemäß externem Datenanbieter oder auf Differenzen im von dem Anbieter bereitgestellten externen Rating des Emittenten zurückzuführen.

2. CVaR

| | CVaR | Abdeckung |
|----------------------------|--------|-----------|
| Bezugszeitraum 2022 | -5,0 % | 17 % |
| Bezugszeitraum 2023 | -5,4 % | 21 % |

Die CVaR-Prognose hat sich im Vergleich zum Vorjahr aufgrund von einer verbesserten Datenabdeckung bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmensemittenten und Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmensemittenten sowie Handelsaktivitäten im Portfolio verändert.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße.

| | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|-------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0 |
| Bezugszeitraum 2023 | 0 |

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Manager nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

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

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

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

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

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager) berücksichtigt.

Der Manager berücksichtigte in Bezug auf die Nachhaltigkeitsfaktoren die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 1 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für Unternehmensemittenten (die „**PAIs für Unternehmensemittenten**“), und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 2 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für staatliche Emittenten (die „**staatliche PAIs**“) (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“):

| Teil 1 – PAIs für Unternehmensemittenten | |
|--|--|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| Treibhausgasemissionen | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| Soziales und Beschäftigung | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

| Teil 2 – staatliche PAIs | |
|--------------------------|---|
| Umwelt | PAI 15 - THG-Emissionsintensität |
| Soziales | PAI 16 - Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel, die vom Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts** entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|---|---|-------------------------|---------------|
| NYKREDIT REALKREDIT A/S RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 2,5 % | Dänemark |
| PORTUGAL (REPUBLIC OF) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 2,0 % | Portugal |
| BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO MTN RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 2,0 % | Polen |
| ITALY (REPUBLIC OF) RegS | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,6 % | Italien |
| NYKREDIT REALKREDIT A/S RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 1,5 % | Dänemark |
| EUROPEAN UNION RegS | U – Exterritoriale Organisationen und Körperschaften | 1,5 % | Supranational |
| POLAND (REPUBLIC OF) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,5 % | Polen |
| SPAIN (KINGDOM OF) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,4 % | Spanien |
| ITALY (REPUBLIC OF) RegS | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,3 % | Italien |
| ITALY (REPUBLIC OF) RegS | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,3 % | Italien |
| ITALY REPUBLIC OF | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,3 % | Italien |

| | | | |
|---|---|-------|-------------|
| CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 1,2 % | Kanada |
| CROATIA (REPUBLIC OF) RegS | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,2 % | Kroatien |
| KFW MTN RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 1,2 % | Deutschland |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 1,2 % | Australien |

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: *Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.*



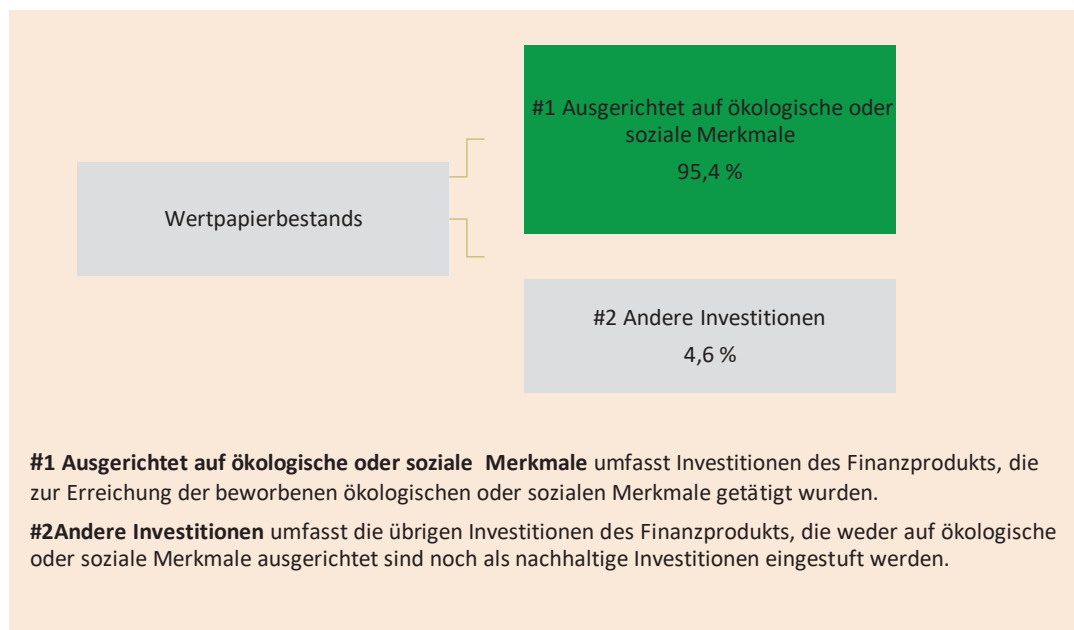
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 95,4 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 4,6 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



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

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|--|-------------------------|
| B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden | 0,2 % |
| C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 3,7 % |
| D – Energieversorgung | 4,1 % |
| E – Wasserversorgung, Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen | 0,9 % |
| G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 0,4 % |
| H – Verkehr und Lagerei | 0,5 % |
| J – Information und Kommunikation | 2,6 % |
| K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 38,2 % |
| L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 5,9 % |
| M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen | 0,1 % |
| N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 0,4 % |
| O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 37,0 % |
| R – Kunst, Unterhaltung und Erholung | 0,8 % |
| U – Extraterritoriale Organisationen und Körperschaften | 4,9 % |
| Keine | 0,3 % |

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

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

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine 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?

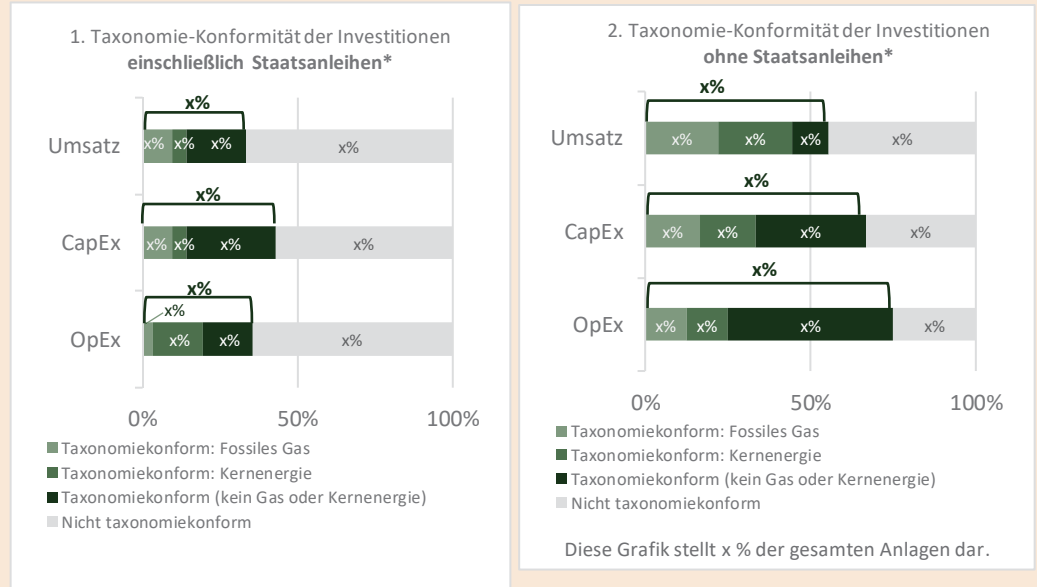
- Ja:
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

¹ Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



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

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder zur Gewährleistung einer adäquaten Liquidität, Absicherung und Besicherung.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittentenanalysen durch die Investmentteams des Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in seine internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Manager arbeitete mit den Emittenten über ein solides ESG-Dialogprogramm zusammen. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung der Mitwirkung verfolgt.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
k.A.

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

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten.

Name des Produkts: Neuberger Berman European High Yield Bond Fund (das „Portfolio“)

Unternehmenskennung: 549300Z7RL5FC5H5DB41

Ökologische und/oder soziale Merkmale

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

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

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

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

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

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

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

Nein

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

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

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

mit einem sozialen Ziel

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

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „Bezugszeitraum“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO₂-Fußabdrucks*, Treibhausgasemissionen („**THG**“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, Recycling-Praktiken und -Trends, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen zur Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

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

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („NB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentrierte, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen werden. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen. Jedes Sektorkriterium wurde unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistentams für das Portfolio genutzt wurde.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existierte kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergriffen hat, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Des Weiteren war der Sub-Investment-Manager bestrebt, eine konstruktive Zusammenarbeit mit den Unternehmensemittenten zu priorisieren. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Bezugszeitraum | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | 60 | 1-100 | 99 % |
| Daten von Dritten | 6,1 | 0-10 | |

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 das niedrigste und 100 das höchste Rating darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmensemittenten gemessen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und Chancen durch den Klimawandel pro Emission und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit eine Emission durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 10,1 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 36 %, die auf Basis des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden ermittelt wurde.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstoßen haben oder nicht mit diesen vereinbar waren. Seit dem 2. August 2023 wendet das Portfolio die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy an. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlage des Portfolios).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

| | NB-ESG-Quotient-Rating | Rating der Daten durch externe Anbieter | Kombinierte Abdeckung |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| Bereich | 1-100 | 0-10 | 0-100 % |
| Bezugszeitraum 2022 | 59 | 5,5 | 98 % |
| Bezugszeitraum 2023 | 60 | 6,1 | 99 % |

Die Bewertung des NB-ESG-Quotienten hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

Das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen sowie auf potenzielle Änderungen oder Unterschiede im externen Emittenten-Rating.

2. CVaR

| | CVaR | Abdeckung |
|----------------------------|-------------|------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | -8,7 % | 34 % |
| Bezugszeitraum 2023 | -10,1 % | 36 % |

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die CVaR-Prognose aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmensemittenten und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verändert.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

| | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|--------------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0 |
| Bezugszeitraum 2023 | 0 |

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

k.A.

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

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

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

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

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

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



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| PAIs auf Produktebene | |
|-----------------------------------|--|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgas-emissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|---|--|-------------------------|----------------|
| LORCA TELECOM BONDCO SAU RegS | J – Information und Kommunikation | 1,5 % | Spanien |
| EDP - ENERGIAS DE PORTUGAL SA MTN RegS | D – Energieversorgung | 1,3 % | Portugal |
| CELLNEX TELECOM SA MTN RegS | J – Information und Kommunikation | 1,2 % | Spanien |
| ABERTIS INFRAESTRUCTURAS FINANCE B RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 1,1 % | Spanien |
| DOUGLAS GMBH RegS | G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 1,1 % | Deutschland |
| BELLIS ACQUISITION COMPANY PLC RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 1,1 % | Großbritannien |
| VALEO SE MTN RegS | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 1,0 % | Frankreich |
| TELECOM ITALIA SPA MTN RegS | J – Information und Kommunikation | 1,0 % | Italien |
| TECHEM VERWALTUNGSGESELLSCHAFT 675 RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 1,0 % | Deutschland |
| BAYER AKTIENGESELLSCHAFT RegS | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 0,9 % | Deutschland |
| NGG FINANCE PLC RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 0,9 % | Großbritannien |
| CECONOMY AG RegS | G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 0,9 % | Deutschland |
| IHO VERWALTUNGS GMBH RegS | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 0,8 % | Deutschland |
| NIDDA HEALTHCARE HOLDING GMBH RegS | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 0,8 % | Deutschland |
| VERISURE HOLDING AB RegS | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 0,8 % | Schweden |



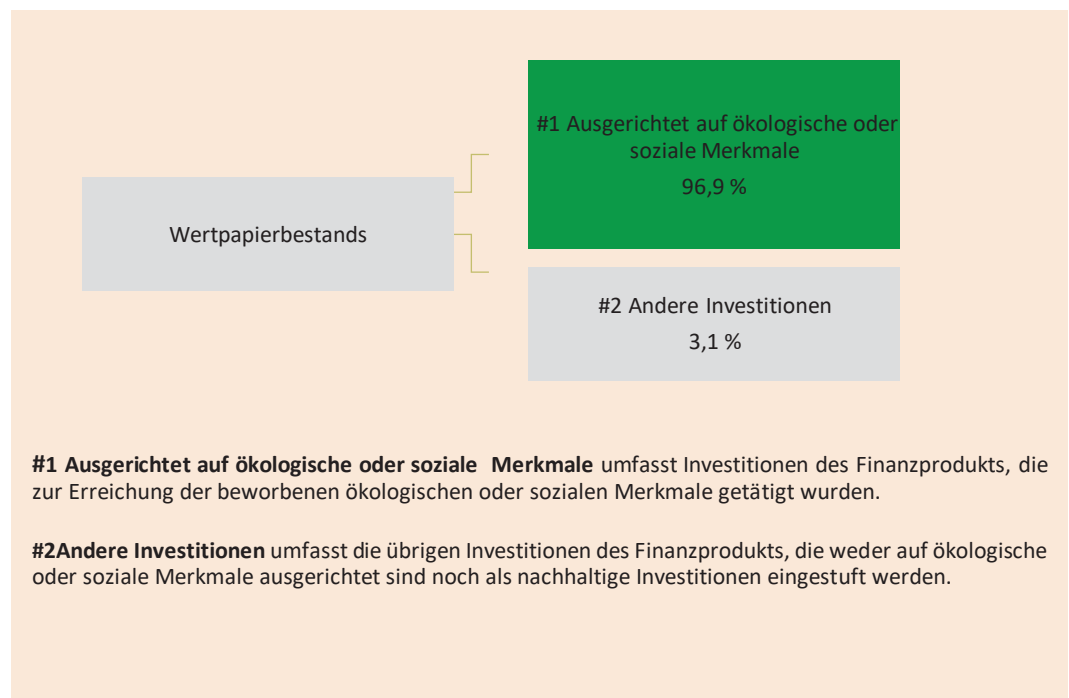
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 96,9 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 3,1 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Der Bezugszeitraum ist ein Durchschnitt der vier Kalenderquartalsenden.



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

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Bildung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|--|-------------------------|
| C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 25,2 % |
| D – Energieversorgung | 1,4 % |
| E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen | 0,4 % |
| G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 5,9 % |
| H - Verkehr und Lagerei | 3,5 % |
| I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie | 0,8 % |
| J – Information und Kommunikation | 17,0 % |
| K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 35,8 % |
| L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 2,9 % |
| M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Tätigkeiten | 0,7 % |
| N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 4,7 % |
| P – Erziehung und Unterricht | 0,7 % |
| R – Kunst, Unterhaltung und Erholung | 0,9 % |
| Keine | 0,3 % |



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

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

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

Nicht zutreffend – Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomeikonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

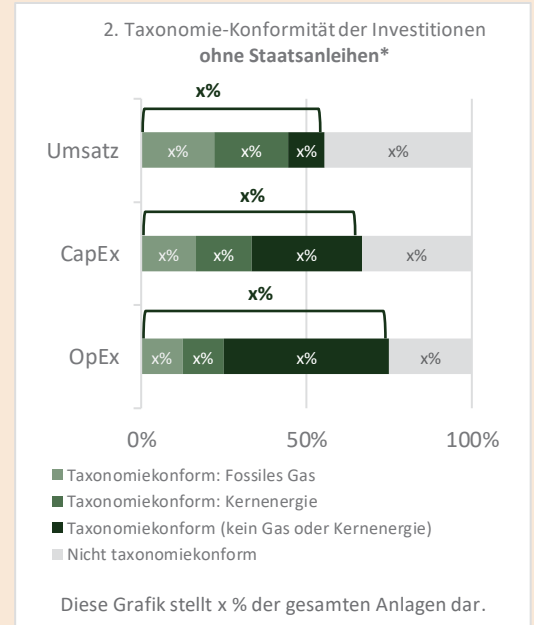
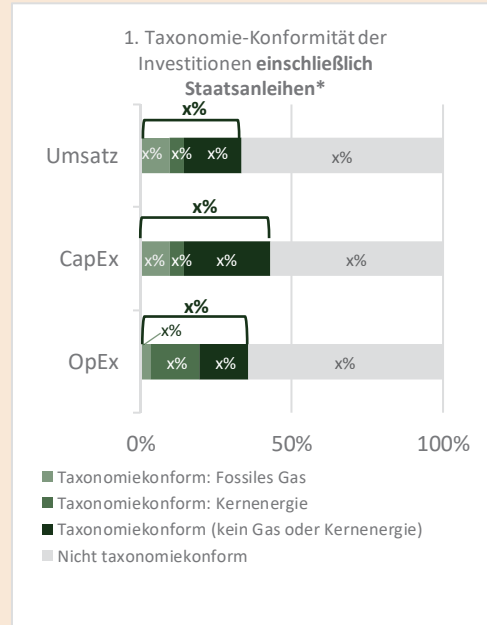
- Ja: In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

¹ Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



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

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittenteanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

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

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
k.A.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman European Sustainable Equity Fund (das „Portfolio“)

Unternehmenskennung: 549300K7Y3HBTEX71857

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

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

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

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

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

Nein

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 59.9 %* an nachhaltigen Investitionen.

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

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

mit einem sozialen Ziel

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

*Weitere Einzelheiten zur Vermögensallokation des Portfolios (einschließlich des Engagements in nachhaltige Investitionen) finden Sie unter der Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „Bezugszeitraum“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

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

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



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („**THG**“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.

In dem Bestreben, das Portfolio auf ein Netto-Null-Ziel auszurichten, bewirbt der Manager die Verringerung des CO₂-Fußabdrucks des Portfolios in Bezug auf Scope-1-, Scope-2- und wesentliche Scope-3-Treibhausgasemissionen.¹ Es existiert kein jährliches Reduktionsziel. Stattdessen wird sich auf das Zwischenziel 2030 und das Netto-Null-Ziel 2050 konzentriert.

- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzmitteln und zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Anreize für Mitarbeiter und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsnormen in der Lieferkette, Vielfalt und Integration der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortungsvolles Marketing.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

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

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigte der Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**NB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteten ESG-Daten erstellt. Ergänzend kamen interne qualitative Analysen hinzu, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient- oder externes Rating aufweisen, um im Laufe der Zeit

¹Scope-1-Emissionen sind direkte Emissionen aus Quellen, die sich im Besitz des Unternehmens befinden oder von ihm kontrolliert werden (z. B. Emissionen, die sich direkt durch die Geschäftsprozesse des Unternehmens oder durch Fahrzeuge im Besitz des Unternehmens ergeben). Scope-2-Emissionen sind indirekte Emissionen aus der Erzeugung von Strom, Dampf, Wärme und Kälte, die vom Unternehmen verbraucht werden. Scope-3-Emissionen sind alle anderen indirekten Emissionen, die in der Wertschöpfungskette eines Unternehmens anfallen (u. a. Emissionen aus den vom Unternehmen verbrauchten Produkten oder Dienstleistungen, aus der Entsorgung seiner Abfälle, aus dem Pendelverkehr seiner Mitarbeiter, aus dem Vertrieb und Transport seiner Produkte oder aus seinen Investitionen).

eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachen) zu erreichen.

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Bezugszeitraum | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|-----------------|-------------------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | ES: B G: 3,0 | ES: A-D G: 1-4 | 99 % |
| Daten von Dritten | 7,9 | 0-10 | |

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale („**ES**“) werden die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („**G**“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und der Chancen durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 5,7 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 99 %, was einem Durchschnitt der CVaR-Abdeckung über die vier Kalenderquartalsenden hinweg entspricht.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy und die Neuberger Berman Enhanced Sustainable Exclusion Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht mehr in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstößend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen. Das Portfolio hat nicht in Unternehmen investiert, die mehr als 5% ihrer Umsätze über Hersteller von Pelz, Spezialleder oder militärische Auftragnehmer erzielten. Darüber hinaus schloss das Portfolio Unternehmen aus dem Anlageuniversum aus, die an umstrittenen Tätigkeiten und Verhaltensweisen beteiligt waren, darunter Glücksspiele, Alkohol und Kernenergie. Ferner schloss das Portfolio Unternehmen aus, die in diktatorische Regime/große ESG-Kontroversen verwickelt waren, Unternehmen, die ein sehr schlechtes Verhalten in Bezug auf Umweltverschmutzung, Menschenrechtsfragen oder Governance-Kontroversen an den Tag legten, und Unternehmen, die in Bezug auf ESG nicht transparent waren oder bei ESG-Kennzahlen insgesamt sehr schlecht abschnitten.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

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

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

| | NB-ESG-Quotient-Rating | Rating der Daten durch externe Anbieter | Kombinierte Abdeckung |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| Bereich | ES: A-D G: 1-4 | 0-10 | 0-100 % |
| Bezugszeitraum 2022 | ES: B G: 2,5 | 7,9 | 100 % |
| Bezugszeitraum 2023 | ES: B G: 3,0 | 7,9 | 99 % |

Das ES-Rating des NB-ESG-Quotienten ist im Vergleich zum Vorjahr unverändert geblieben.

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich das G-Rating des NB-ESG-Quotienten aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmen und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verändert.

Das Rating der Daten durch externe Anbieter blieb im Vergleich zum Vorjahr unverändert.

2. CVaR

| | CVaR | Abdeckung |
|----------------------------|-------------|------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | -6,2 % | 99 % |
| Bezugszeitraum 2023 | -5,7 % | 99 % |

Der durch die CVaR prognostizierte Verlust hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmen und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

| | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|--------------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0 |
| Bezugszeitraum 2023 | 0 |

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

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt,

(ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat, wie nachstehend erläutert, und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Unternehmens, um festzustellen, ob das Unternehmen einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Unternehmens auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Manager überprüfte die Unternehmen auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Unternehmen dieser Prüfung standhielten, quantifizierte der Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag der Unternehmen zur Wirtschaft.

Der Manager erfasste dies auf zwei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDGs“).

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbaren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

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

Der Manager wendete seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigen. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und auf Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Manager berücksichtigte bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „PAIs“):

| PAIs | |
|-------------------------------|--|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgasemissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind PAI 5 - Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren |
| <i>Biodiversität</i> | PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken |
| <i>Wasser</i> | PAI 8 - Emissionen in Wasser |
| <i>Abfall</i> | PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle |

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

| | |
|-----------------------------------|--|
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | <p>PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen</p> <p>PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen</p> <p>PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle</p> <p>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen</p> <p>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)</p> |
|-----------------------------------|--|

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Manager hat auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Der Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Manager bei der Feststellung, ob die durch das Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Unternehmen, die unter die vom Manager für jede PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Unternehmen, die unter die vom Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

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

Der Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

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

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

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

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Manager) berücksichtigt.

Der Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „*Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?*“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.
2. Der Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| PAIs auf Produktebene | |
|-----------------------------------|--|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgas-emissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel, die vom Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|---------------------------------|--|-------------------------|----------------|
| ASML HOLDING NV | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 5,7 % | Niederlande |
| NESTLE SA | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 5,5 % | Schweiz |
| 3I GROUP PLC | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 5,2 % | Großbritannien |
| SCHNEIDER ELECTRIC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 4,6 % | USA |
| LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 4,4 % | Großbritannien |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 4,2 % | Schweiz |
| EURONEXT NV | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 4,0 % | Niederlande |
| ASSA ABLOY CLASS B | N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 3,8 % | Schweden |
| LOREAL SA | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 3,7 % | Frankreich |
| STRAUMANN HOLDING AG | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 3,7 % | Schweiz |
| KERING SA | G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 3,6 % | Frankreich |
| ATLAS COPCO CLASS A | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 3,6 % | Schweden |
| BAKKAFROST | A – Landwirtschaft, Forstwirtschaft und Fischerei | 3,3 % | Faröer Inseln |
| ADYEN NV | J – Information und Kommunikation | 3,2 % | Niederlande |
| SCOUT24 N | J – Information und Kommunikation | 3,0 % | Deutschland |



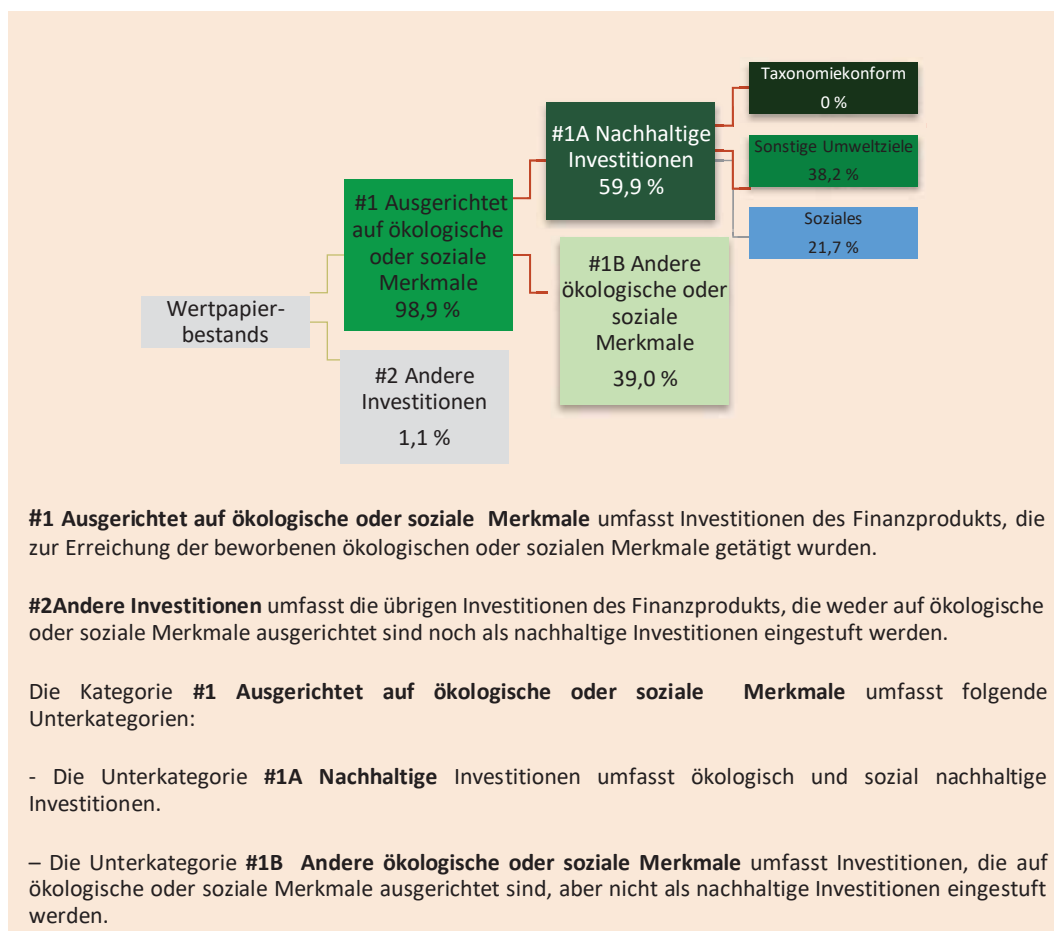
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 98,9 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio verpflichtet sich, mindestens 50 % an nachhaltigen Investitionen zu halten. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 59,9 % an nachhaltigen Investitionen.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 1,1 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



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

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|--|-------------------------|
| A – Landwirtschaft, Forstwirtschaft und Fischerei | 3,3 % |
| C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 51,0 % |
| G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 7,7 % |
| J – Information und Kommunikation | 13,4 % |
| K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 18,2 % |
| M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Tätigkeiten | 2,5 % |
| N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 3,9 % |



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

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

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine 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?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert²?

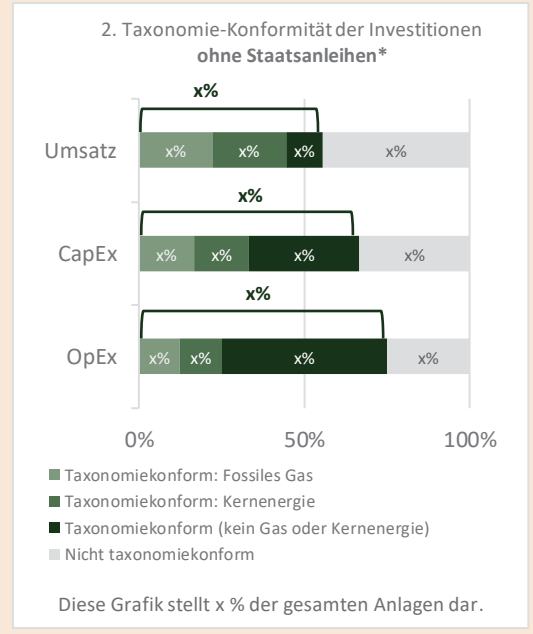
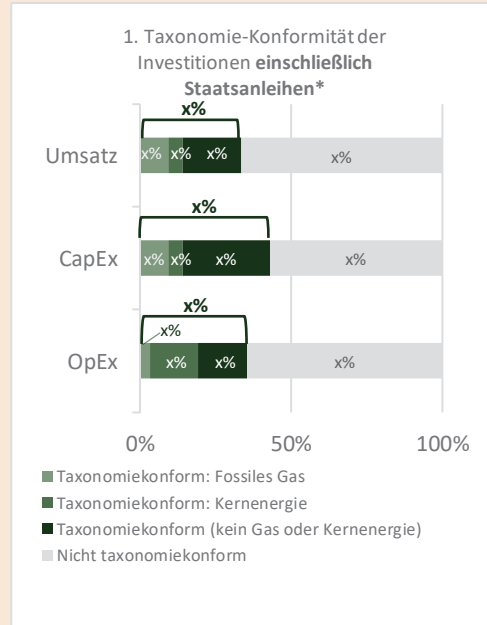
Ja:
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

² Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



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

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Das Portfolio hielt 38,2 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, das nicht mit der EU-Taxonomie konform ist.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Das Portfolio hielt 21,7 % an sozial nachhaltigen Investitionen.



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

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder zur Gewährleistung einer adäquaten Liquidität, Absicherung und Besicherung.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das externe oder NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die Gesamtbetrachtung der Unternehmen bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Manager arbeitete mit den Unternehmen über ein solides ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung der Mitwirkung verfolgt.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
k.A.

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

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Global Bond Fund (das „Portfolio“)

Unternehmenskennung: 549300RDJHEJZZ6XVX05

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

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

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

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

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

Nein

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

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

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

mit einem sozialen Ziel

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

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „Bezugszeitraum“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

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

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



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO₂-Fußabdrucks, Umweltmanagement, Treibhausgasemissionen („**THG**“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, Gelegenheiten für erneuerbare Energien, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikoübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen in der Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses haben der Manager und der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**MB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Manager und Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergriff, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühten sich der Manager und der Sub-Investment-Manager einem konstruktiven Dialog mit Emittenten mit einer schlechten Bewertung des NB-ESG-Quotienten Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

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

| Bezugszeitraum | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | 66 | 1-100 | 67 % |
| Daten von Dritten | 6,6 | 0-10 | |

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet. Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmensemittenten gemessen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und Chancen durch den Klimawandel pro Emission und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit eine Emission durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 1,6 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Managers und des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Manager und der Sub-Investment-Manager der Teilstrategie über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 19 %, was einem Durchschnitt der Werte zum Ende der vier Kalender quartale entspricht.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagten der Manager und der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen. Darüber hinaus schloss das Portfolio Emittenten von Unternehmensanleihen aus den Schwellenländern aus, die in der Tabakindustrie tätig und an Kinderarbeit beteiligt waren.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich haben der Manager und der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise ihrer Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager erörterten und diskutierten die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund ihres eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlage des Portfolios).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalender quartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

| | NB-ESG-Quotient-Rating | Rating der Daten durch externe Anbieter | Kombinierte Abdeckung |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| Bereich | 1-100 | 0-10 | 0-100 % |
| Bezugszeitraum 2022 | 68 | 6,5 | 77 % |
| Bezugszeitraum 2023 | 66 | 6,6 | 67 % |

Das NB-ESG-Quotient-Rating hat sich im Vergleich zum Vorjahr verschlechtert, und das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich verbessert. Dies ist unter Umständen auf eine Verbesserung bei den einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten gemäß externem Datenanbieter oder auf Differenzen im von dem Anbieter bereitgestellten externen Rating des Emittenten zurückzuführen.

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die kombinierte Abdeckung durch den NB-ESG-Quotienten und das externe Rating verschlechtert. Die ESG-Analyse wird intern durchgeführt, mit Unterstützung durch die Daten externer Anbieter, und nicht ausgelagert. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nehmen auf kontinuierlicher Basis Bewertungen dieser ESG-Merkmale vor. Von Zeit zu Zeit kann es vorkommen, dass einem Emittent zum Zeitpunkt der Anlage für einen kurzen Zeitraum kein NB-ESG-Quotient-Rating zugewiesen wird. Der Manager und der Sub-Investment-Manager stehen in regelmäßigen Abständen mit externen Anbietern von ESG-Daten in Kontakt, um Themen wie die Datenabdeckung zu diskutieren und Optionen zur Behebung von Datenlücken zu prüfen. Die Nutzung mehrerer externer Anbieter von ESG-Daten ermöglicht es dem Manager und dem Sub-Investment-Manager, die Datenabdeckung und die Qualität der Daten der externen Anbieter von ESG-Daten zu bewerten. Darüber hinaus prüfen der Manager und der Sub-Investment-Manager weiterhin neue ESG-Datenprodukte und externe Anbieter von ESG-Daten, um potenzielle Verbesserungen unserer bestehenden ESG-Datenabdeckung zu bewerten.

2. CVaR

| | CVaR | Abdeckung |
|----------------------------|--------|-----------|
| Bezugszeitraum 2022 | -1,7 % | 24 % |
| Bezugszeitraum 2023 | -1,6 % | 19 % |

Der durch die CVaR prognostizierte Verlust hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmensemittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die CVaR-Abdeckung aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmensemittenten und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verändert.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße.

| | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|-------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0 |
| Bezugszeitraum 2023 | 0 |

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, und der Manager und der Sub-Investment-Manager waren nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

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

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

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

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager und den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten in Bezug auf die Nachhaltigkeitsfaktoren die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 1 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für Unternehmensemittenten (die „**PAIs für Unternehmensemittenten**“), und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 2 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für staatliche Emittenten (die „**staatliche PAIs**“) (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“):

| Teil 1 – PAIs für Unternehmensemittenten | |
|---|--|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgas-emissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |
| Teil 2 – staatliche PAIs | |
| <i>Umwelt</i> | PAI 15 - THG-Emissionsintensität |
| <i>Soziales</i> | PAI 16 - Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager und den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|---------------------------------|--|-------------------------|----------------|
| CANADA (GOVERNMENT OF) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung | 2,27 % | Kanada |
| KOREA (REPUBLIC OF) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung | 1,81 % | Republik Korea |
| JAPAN (GOVERNMENT OF) 5YR #149 | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung | 1,75 % | Japan |
| HESSE (STATE OF) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung | 1,51 % | Deutschland |
| INDONESIA GOVERNMENT BOND | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung | 1,26 % | Indonesien |
| KOREA (REPUBLIC OF) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung | 1,07 % | Republik Korea |
| GEMEINSAME BUNDESLÄENDER RegS | k.A. | 1,06 % | Deutschland |
| CROATIA (REPUBLIC OF) RegS | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung | 0,99 % | Kroatien |
| NYKREDIT REALKREDIT A/S RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 0,96 % | Dänemark |
| INDONESIA (REPUBLIC OF) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung | 0,90 % | Indonesien |
| UK I/L GILT RegS | k.A. | 0,86 % | Großbritannien |
| JAPAN (GOVERNMENT OF) 30YR #61 | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung | 0,85 % | Japan |
| JAPAN (GOVERNMENT OF) 20YR #178 | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung | 0,85 % | Japan |
| MADRID COMMUNITY OF RegS | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung | 0,84 % | Spanien |
| FNMA 30YR UMBS | k.A. | 0,82 % | k.A. |

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

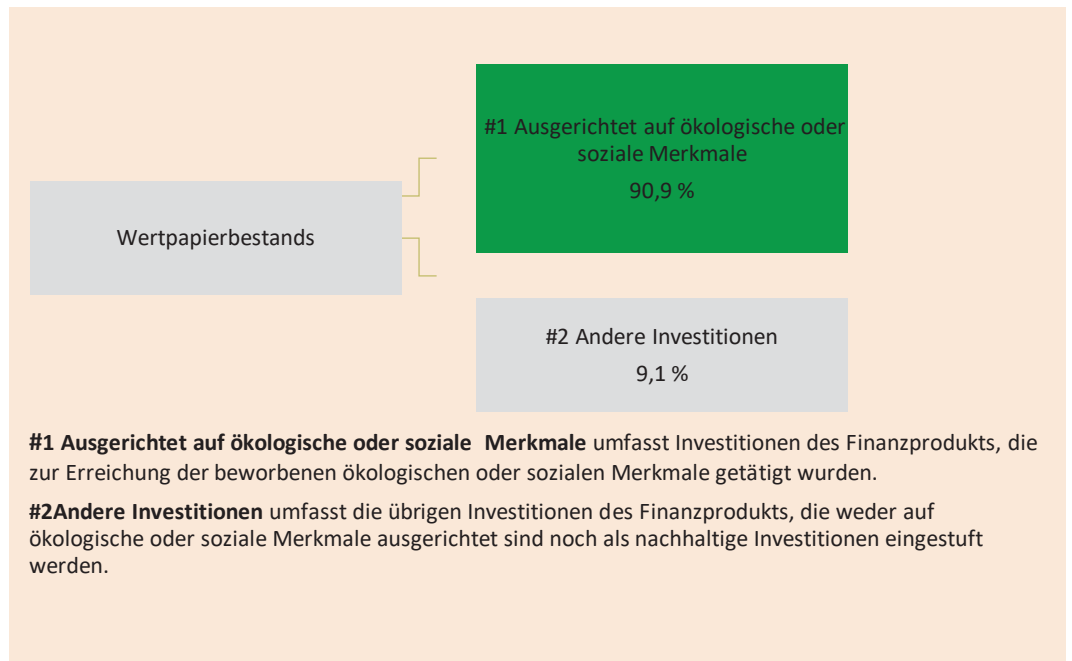
Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 60 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 90,9 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 40 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 9,1 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berechneten den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager und der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatten. Diese Berechnung basierte auf einer

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



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

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Bildung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|--|-------------------------|
| B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden | 0,7 % |
| C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 5,4 % |
| D – Energieversorgung | 1,9 % |
| E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen | 0,0 % |
| G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 0,5 % |
| H - Verkehr und Lagerei | 0,3 % |
| I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie | 0,2 % |
| J – Information und Kommunikation | 3,7 % |
| K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 15,1 % |
| L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 0,8 % |
| M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen | 0,4 % |
| N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 0,1 % |
| O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung | 39,2 % |
| U – Extraterritoriale Organisationen und Körperschaften | 2,7 % |
| Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen | 0,2 % |
| Keine | 28,8 % |

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

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

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

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager können bestätigen, dass das Portfolio in Investitionen investiert hat, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager und der Sub-Investment-Manager werden das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

Ja:

In fossiles Gas In Kernenergie

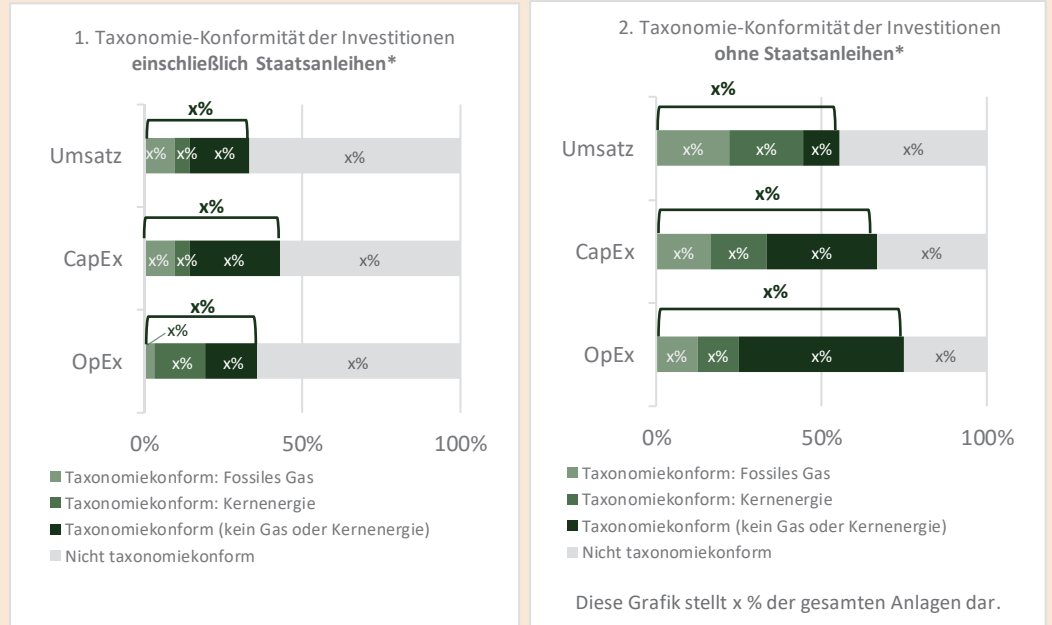
Nein

¹ Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



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

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

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Anlagen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate, Wertpapiere der Kategorie „To be Announced“ [„TBA“] oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert sind, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen einzustufen waren.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager und der Sub-Investment-Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachteten, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen, verhinderten und sie sicherstellen, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager wendeten bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager verstehen unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Managers und des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers und des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager und vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in seine internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager engagierten sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Er strebte danach, konstruktiven Dialogen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachtete. Der Manager und der Sub-Investment-Manager betrachteten diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil ihres Anlageprozesses. Die Fortschritte bei der Einbindung wurden vom Manager und dem Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen

Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
k.A.

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

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Global Diversified Income FMP – 2024 (das „Portfolio“)

Unternehmenskennung: 549300577U1V3H24JG33

Ökologische und/oder soziale Merkmale

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

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

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

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

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

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

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

Nein

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

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

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

mit einem sozialen Ziel

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

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „Bezugszeitraum“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben zudem die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung dieser ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Angesichts des Anlageziels, der Anlagedauer und des Fälligkeitsdatums am 30. Juni 2024 (das „**Fälligkeitsdatum**“) war der Portfolioumschlag begrenzt. Obwohl das Portfolio während seiner gesamten Lebensdauer ökologische und soziale Merkmale bewerben wird, konzentrierte sich die Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale auf die Aufbauphase des Portfolios.

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO₂-Fußabdrucks, Umweltmanagement, Treibhausgasemissionen („**THG**“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, Gelegenheiten für erneuerbare Energien, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikoübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen in der Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB-ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**MB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistenteam für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergreift, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühte sich der Sub-Investment-Manager, konstruktiven Dialogen bei Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

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

| Bezugszeitraum | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | 58 | 1-100 | 99 % |
| Daten von Dritten | 5,2 | 0-10 | |

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet. Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmensemittenten gemessen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und Chancen durch den Klimawandel pro Emission und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit eine Emission durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Wertverlust von 6,8 % führen könnte. Der Bezugszeitraum ist ein Durchschnitt der vier Kalenderquartalsenden.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige

Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 68 %, was einem Durchschnitt der CVaR-Abdeckung über die vier Kalenderquartalsenden hinweg entspricht.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen. Darüber hinaus schloss das Portfolio Emittenten von Unternehmensanleihen aus den Schwellenländern aus, die in der Tabakindustrie tätig und an Kinderarbeit beteiligt waren.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

Da das Portfolio darauf abzielte, eine Rendite über eine bestimmte Laufzeit zu erzielen, die am Fälligkeitsdatum endet, war der Portfolioumschlag begrenzt.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlage des Portfolios).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

| | NB-ESG-Quotient-Rating | Rating der Daten durch externe Anbieter | Kombinierte Abdeckung |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| Bereich | 1-100 | 0-10 | 0 %-100 % |
| Bezugszeitraum 2022 | 57 | 4,9 | 98 % |
| Bezugszeitraum 2023 | 58 | 5,2 | 99 % |

Die Bewertung des NB-ESG-Quotienten hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

Das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen sowie auf potenzielle Änderungen oder Unterschiede im externen Emittenten-Rating.

2. CVaR

| | CVaR | Abdeckung |
|----------------------------|--------|-----------|
| Bezugszeitraum 2022 | -3,6 % | 72 % |
| Bezugszeitraum 2023 | -6,8 % | 68 % |

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die CVaR-Prognose aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmensemittenten und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verändert.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

| | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|-------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0 |
| Bezugszeitraum 2023 | 0 |

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten. Dessen ungeachtet war der Sub-Investment-Manager nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| PAIs auf Produktebene | |
|-----------------------------------|--|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgas-emissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem über die vier Kalenderquartalsenden des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitt basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|--|--|-------------------------|------------------------------|
| NATWEST GROUP PLC | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 2,89 % | Großbritannien |
| GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 2,86 % | USA |
| SPRINT CORP | J – Information und Kommunikation | 2,58 % | USA |
| BALL CORP | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,54 % | USA |
| HSBC HOLDINGS PLC | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 2,52 % | Großbritannien |
| ATHENE GLOBAL FUNDING 144A | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 2,51 % | USA |
| WARNERMEDIA HOLDINGS INC | J – Information und Kommunikation | 2,51 % | USA |
| BARCLAYS PLC | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 2,48 % | Großbritannien |
| NRG ENERGY INC 144A | D – Energieversorgung | 2,47 % | USA |
| MAGALLANES INC 144A | J – Information und Kommunikation | 2,44 % | USA |
| MASHREQBANK PSC RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 2,39 % | Vereinigte Arabische Emirate |
| SYNCHRONY FINANCIAL | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 2,37 % | USA |
| EQT MIDSTREAM PARTNERS LP | H - Verkehr und Lagerung | 2,29 % | USA |
| FORD MOTOR CREDIT COMPANY LLC | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 2,14 % | USA |
| BANK MANDIRI (PERSERO) TBK PT MTN RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 2,13 % | Indonesien |



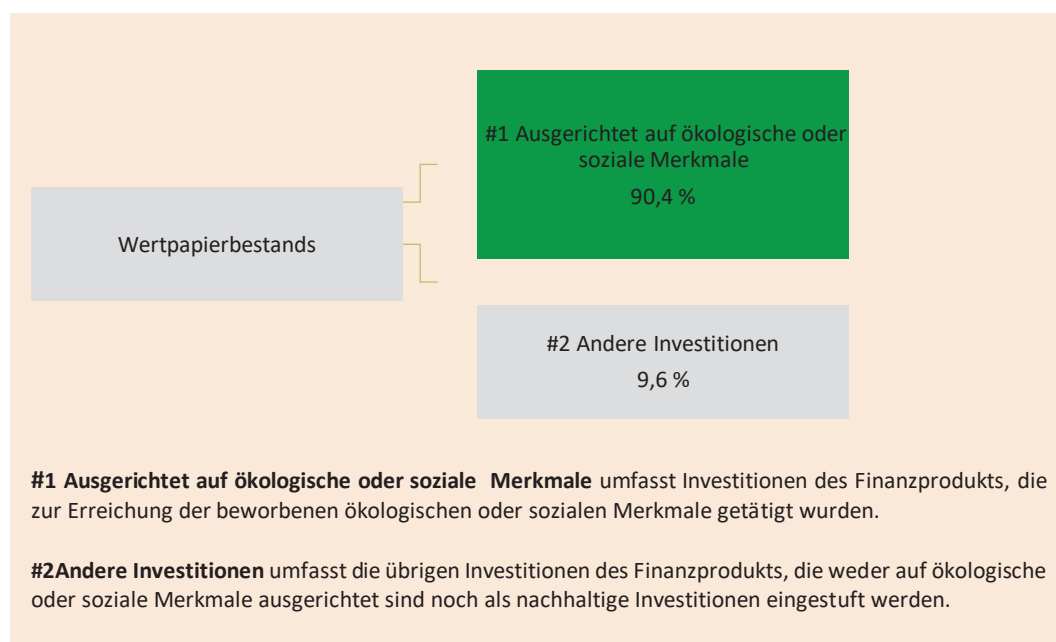
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 90,4 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 9,6 % an „sonstigen Investitionen“.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Der Bezugszeitraum ist ein Durchschnitt der vier Kalenderquartalsenden.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Bildung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|---|-------------------------|
| B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden | 0,7 % |
| C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,1 % |
| D – Energieversorgung | 4,3 % |
| H - Verkehr und Lagerei | 7,4 % |
| F – Baugewerbe/Bau | 1,0 % |
| I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie | 2,0 % |
| J – Information und Kommunikation | 6,8 % |
| K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 62,8 % |
| M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen | 0,7 % |
| L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 0,6 % |
| N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 6,5 % |
| R – Kunst, Unterhaltung und Erholung | 1,8 % |
| U – Extraterritoriale Organisationen und Körperschaften | 1,0 % |
| Keine | 2,3 % |



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Bei-trag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine 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?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

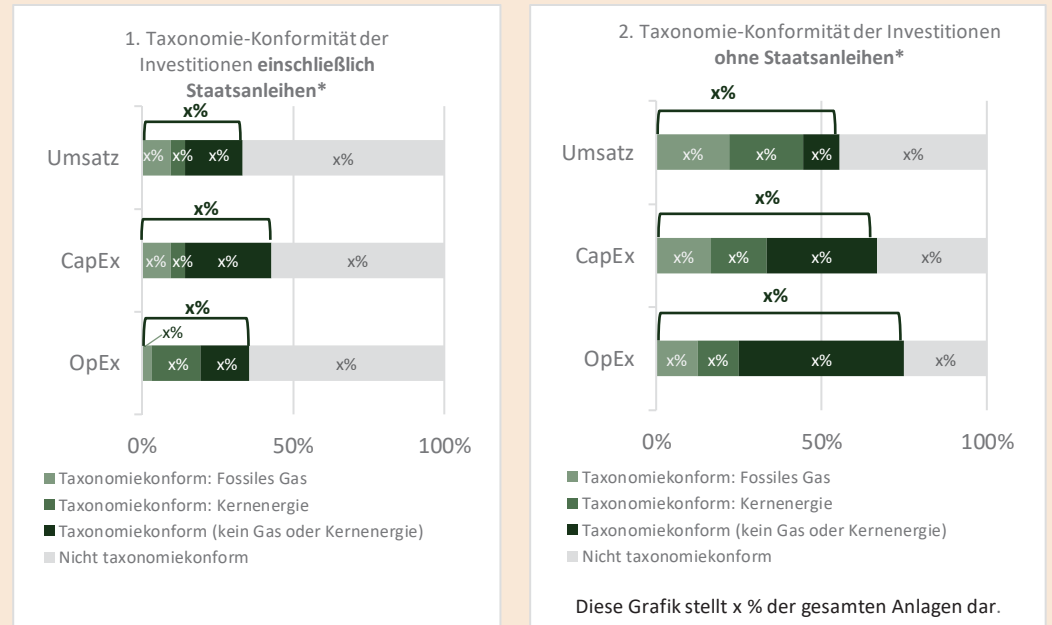
Nein

¹ Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

In Anbetracht des Anlageziels, der Anlagedauer und des Fälligkeitstermins des Portfolios werden zwar während der gesamten Laufzeit des Portfolios ökologische und soziale Merkmale beworben, doch konzentrierte sich die Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale auf die Aufbauphase des Portfolios, da es die Absicht des Sub-Investment-Manager war, einen geringen Portfolioumschlag zu haben.

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittentenanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Sub-Investment-Manager erachtete diese Zusammenarbeit mit Emittenten als wichtigen Bestandteil seines Anlageprozesses, der es ihm ermöglichte sicherzustellen, dass die erstmalige Beurteilung des Emittenten (bei Auflage) weiterhin zutreffend war und in die laufende Bewertung durch das NB-ESG-Quotient-Rating einfluss. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verwendet keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Global Equity Megatrends Fund (das „Portfolio“)
Unternehmenskennung: 549300NOKC884YXB6S20

Ökologische und/oder soziale Merkmale

| Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt? | |
|--|---|
| <input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Ja | <input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Nein |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___% <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht 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 ___% an nachhaltigen Investitionen. <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 |
| <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 wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [here](#).

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („**THG**“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzmitteln und zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Anreize für Mitarbeiter und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsnormen in der Lieferkette, Vielfalt und Integration der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortungsvolles Marketing.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und werden im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**NB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektoorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient- oder externes Rating aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachten) zu erreichen.

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

| Bezugszeitraum | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|-----------------|-------------------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | ES: C G: 2,6 | ES: A-D G: 1-4 | |
| Daten von Dritten | 5,6 | 0-10 | 96 % |

Im Hinblick auf die NB-ESG-Quotient-Ratings der Aktienemittenten werden für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale (ES) die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („G“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Bewertung der Daten Dritter reichen von 0–10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und der Chancen durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 34,2 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 92 %, was einem Durchschnitt der CVaR-Abdeckung über die vier Kalenderquartalsenden hinweg entspricht.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstießen oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

| | NB-ESG-Quotient-Rating | Rating der Daten durch externe Anbieter | Kombinierte Abdeckung |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| Bereich | ES: A-D G: 1-4 | 0-10 | 0-100 % |
| Bezugszeitraum 2022 | ES: C G: 2,5 | 5,4 | 92 % |
| Bezugszeitraum 2023 | ES: C G: 2,6 | 5,6 | 96 % |

Das ES-Rating des NB-ESG-Quotienten ist im Vergleich zum Vorjahr unverändert geblieben, das G-Rating des NB-ESG-Quotienten hat sich verschlechtert und das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich verbessert. Dies ist unter Umständen auf Verbesserungen bei den einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmen gemäß externem Datenanbieter oder auf Differenzen des von dem Anbieter bereitgestellten externen Rating des Unternehmens zurückzuführen.

2. CVaR

| | CVaR | Abdeckung |
|----------------------------|---------|-----------|
| Bezugszeitraum 2022 | -27,9 % | 94 % |
| Bezugszeitraum 2023 | -34,2 % | 92 % |

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die CVaR-Prognose aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmen und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verändert. Wie bereits erwähnt, kann die Szenarioanalyse als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken dienen, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

| | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|-------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0 |
| Bezugszeitraum 2023 | 0 |

- **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.

- **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.

— — — **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

— — — *Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:*

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten. Dessen ungeachtet war der Sub-Investment-Manager nicht in Unternehmen investiert, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die ILO-Grundsätze, die UNGC-Grundsätze, die UNGC-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| PAIs auf Produktebene | |
|-----------------------------------|--|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgasemissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene hing von der Verfügbarkeit angemessener, zuverlässiger und überprüfbarer Daten für diese Indikatoren ab. Stehen solche Daten nicht zur Verfügung, werden die PAIs auf Produktebene erst dann berücksichtigt, wenn diese Daten verfügbar sind. Der Sub-Investment-Manager wird die Liste der von ihm berücksichtigten PAIs auf Produktebene einer aktiven Überprüfung unterziehen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|--|--|-------------------------|----------------|
| PETS AT HOME PLC | G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 5,7 % | Großbritannien |
| CRITEO ADR REPRESENTING SA | M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen | 5,7 % | Frankreich |
| EXPEDIA GROUP INC | N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 5,5 % | USA |
| ALIBABA GROUP HOLDING ADR REPRESENTING | G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 5,4 % | China |
| ALPHABET INC CLASS A | J – Information und Kommunikation | 5,0 % | USA |
| DELTA AIR LINES INC | H – Verkehr und Lagerei | 4,9 % | USA |
| PERRIGO PLC | S – Sonstige Dienstleistungen | 4,7 % | USA |
| STERICYCLE INC | E – Wasserversorgung, Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen | 4,6 % | USA |
| AMDOCS LTD | J – Information und Kommunikation | 4,6 % | USA |
| VISTRA CORP | D – Energieversorgung | 4,6 % | USA |
| ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 4,5 % | Kanada |
| GEN DIGITAL INC | J – Information und Kommunikation | 4,5 % | USA |
| CORNING INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 4,3 % | USA |
| UBER TECHNOLOGIES INC | J – Information und Kommunikation | 4,2 % | USA |
| SCHOLASTIC CORP | J – Information und Kommunikation | 4,1 % | USA |

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023



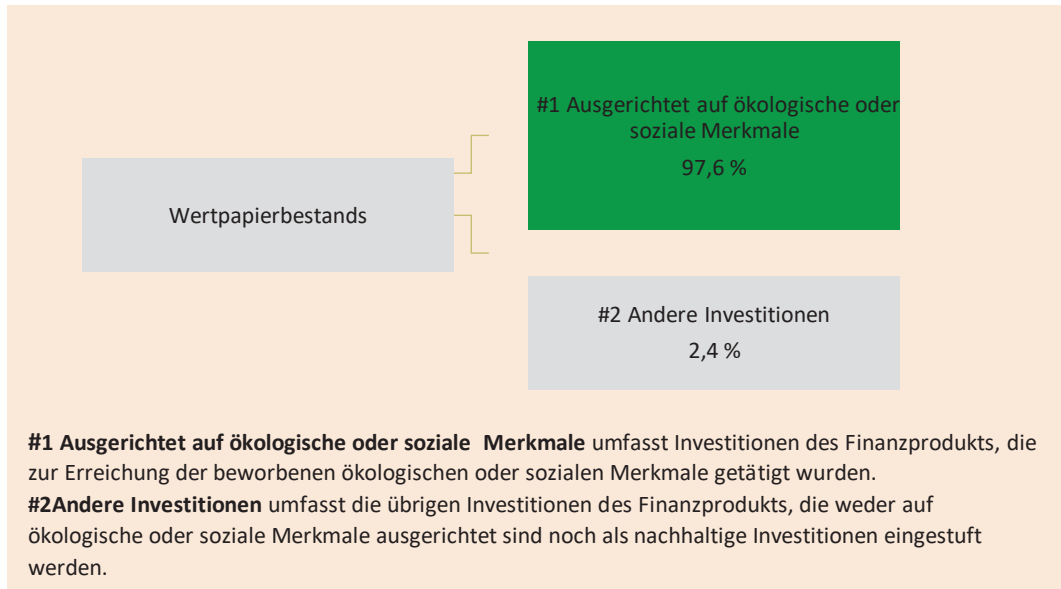
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 97,6 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 2,4 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.



● *In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?*

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|--|-------------------------|
| C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 13,7 % |
| D – Energieversorgung | 4,7 % |
| E – Wasserversorgung, Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen | 4,8 % |
| F – Baugewerbe/Bau | 1,3 % |
| G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 11,3 % |
| H – Verkehr und Lagerei | 5,0 % |
| J – Information und Kommunikation | 26,9 % |
| K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 6,5 % |
| M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen | 7,2 % |
| N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 9,7 % |
| Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen | 4,2 % |
| S – Sonstige Dienstleistungen | 4,8 % |

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

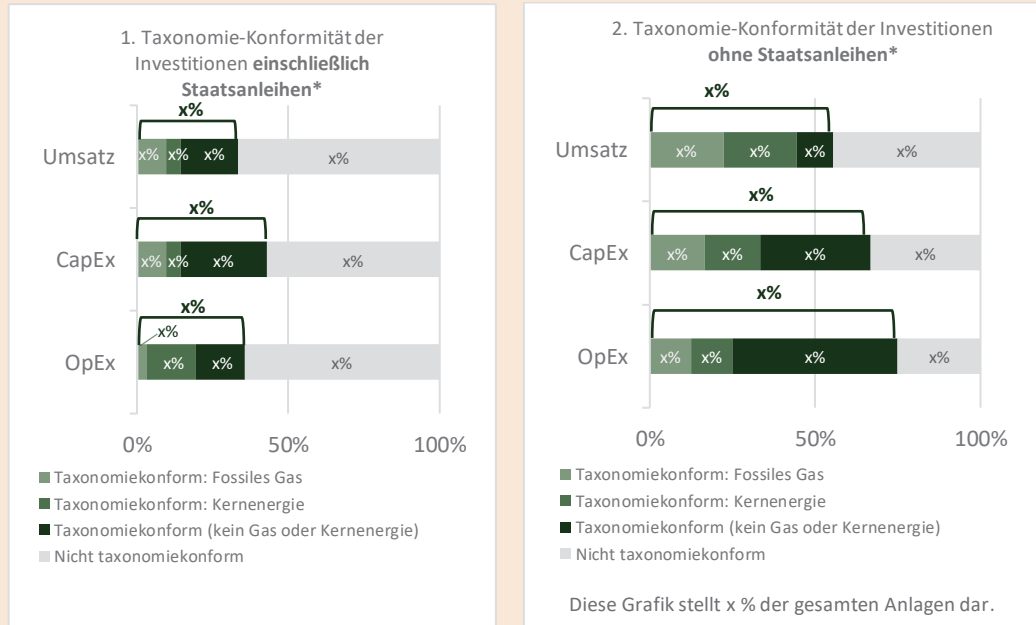
Nein



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die **Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

¹ Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



- **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.



- **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Anlagen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert sind, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen einzustufen waren.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das externe oder NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung eines Unternehmens besser zu

erkennen, wobei darauf hingewiesen wird, dass sich der Schwerpunkt des Portfolios auf Investitionen in Unternehmen konzentrierte, die globalen langfristigen Themen ausgesetzt sind.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die thematische Beurteilung und die Gesamtbeurteilung des Unternehmens bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung der Mitwirkung verfolgt.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

k.A.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

k.A.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

k.A.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

k.A.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Global Flexible Credit Income Fund (das „Portfolio“)

Unternehmenskennung: 5493004BPE0UFYX6FZ81

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Nein

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „Bezugszeitraum“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO₂-Fußabdrucks, Umweltmanagement, Treibhausgasemissionen („**THG**“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, Gelegenheiten für erneuerbare Energien, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikoübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen in der Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**MB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistenteam für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Emittenten ein, die einen schlechten NB-ESG-Quotienten aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachen) zu erreichen.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

| Bezugszeitraum | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | 63 | 1-100 | 93 % |
| Daten von Dritten | 5,5 | 0-10 | |

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet. Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmensemittenten gemessen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und Chancen durch den Klimawandel pro Emission und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit eine Emission durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 12,3 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 42 %, was einem Durchschnitt der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale entspricht.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen. Darüber hinaus schloss das Portfolio Emittenten von Unternehmensanleihen aus den Schwellenländern aus, die in der Tabakindustrie tätig und an Kinderarbeit beteiligt waren.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlage des Portfolios).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

| | NB-ESG-Quotient-Rating | Rating der Daten durch externe Anbieter | Kombinierte Abdeckung |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| Bereich | 1-100 | 0-10 | 0-100 % |
| Bezugszeitraum 2022 | 62 | 5,1 | 93 % |
| Bezugszeitraum 2023 | 63 | 5,5 | 93 % |

Die Bewertung des NB-ESG-Quotienten hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

Das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen sowie auf potenzielle Änderungen oder Unterschiede im externen Emittenten-Rating.

2. CVaR

| | CVaR | Abdeckung |
|----------------------------|-------------|------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | -12,9 % | 48 % |
| Bezugszeitraum 2023 | -12,3 % | 42 % |

Der durch die CVaR prognostizierte Verlust hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmensemittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die CVaR-Abdeckung aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmensemittenten und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verändert.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

| | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|--------------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0 |
| Bezugszeitraum 2023 | 0 |

- **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| PAIs auf Produktebene | |
|-----------------------------------|--|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgas-emissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|------------------------------------|---|-------------------------|------------|
| MCAFEE PIK PREF EQUITY Prvt | J – Information und Kommunikation | 2,4 % | USA |
| TREASURY NOTE (OTR) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,7 % | USA |
| TREASURY BOND (OTR) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,6 % | USA |
| BOEING CO | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 1,1 % | USA |
| AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCA | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 0,9 % | Irland |
| EPR PROPERTIES | L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 0,8 % | USA |
| BROADCOM INC 144A | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 0,8 % | USA |
| CDW LLC/CDW FINANCE | J – Information und Kommunikation | 0,7 % | USA |
| ILIAD HOLDINGS SAS RegS | J – Information und Kommunikation | 0,7 % | Frankreich |

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

| | | | |
|---|---|-------|-------------|
| TECHEM VERWALTUNGSGESELLSCHAFT 675 RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 0,6 % | Deutschland |
| LORCA TELECOM BONDCO SAU RegS | J – Information und Kommunikation | 0,6 % | Spanien |
| GENERAL MOTORS CO | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 0,6 % | USA |
| AIR CANADA 2020-2 CLASS A 144A | k.A. | 0,6 % | Kanada |
| PANTHER BF AGGREGATOR 2 LP / PANTH RegS | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 0,6 % | USA |
| UNITED AIR 2020-1 A PTT | H - Verkehr und Lagerung | 0,6 % | USA |

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.



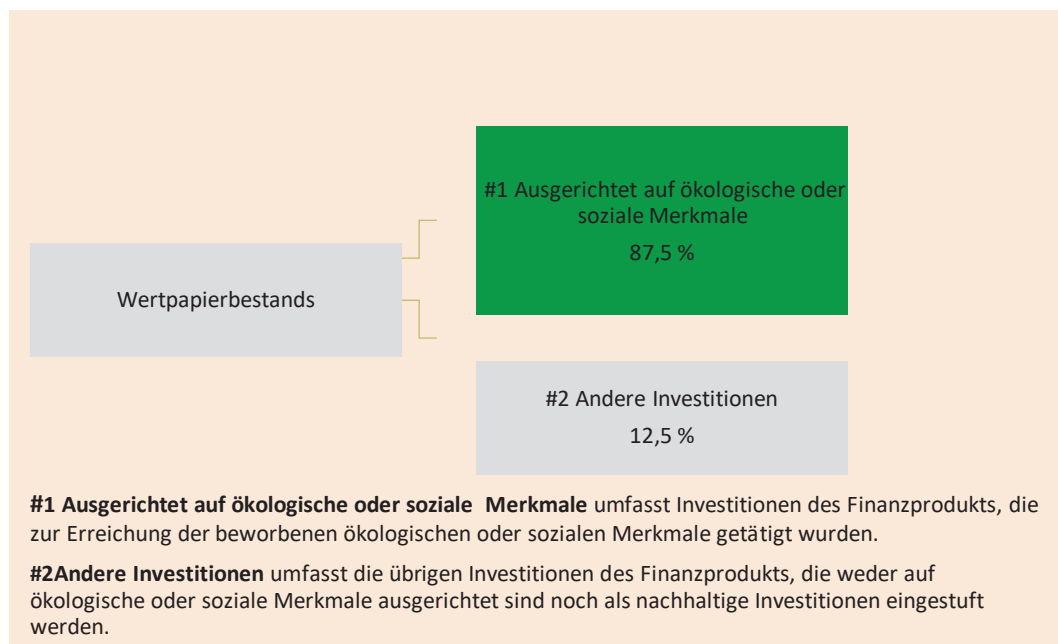
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 87,5 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 12,5 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|--|-------------------------|
| B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden | 5,6 % |
| C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 13,8 % |
| D – Energieversorgung | 2,6 % |
| E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen | 0,4 % |
| F – Baugewerbe/Bau | 0,8 % |
| G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 2,9 % |
| H – Verkehr und Lagerei | 5,7 % |
| I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie | 0,4 % |
| J – Information und Kommunikation | 11,7 % |
| K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 34,0 % |
| L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 3,0 % |
| M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen | 0,7 % |
| N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 3,2 % |
| O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 8,0 % |
| P – Erziehung und Unterricht | 0,0 % |
| Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen | 1,3 % |
| R – Kunst, Unterhaltung und Erholung | 2,0 % |
| S – Sonstige Dienstleistungen | 0,0 % |
| U – Exterritoriale Organisationen und Körperschaften | 0,1 % |
| Keine | 3,7 % |

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

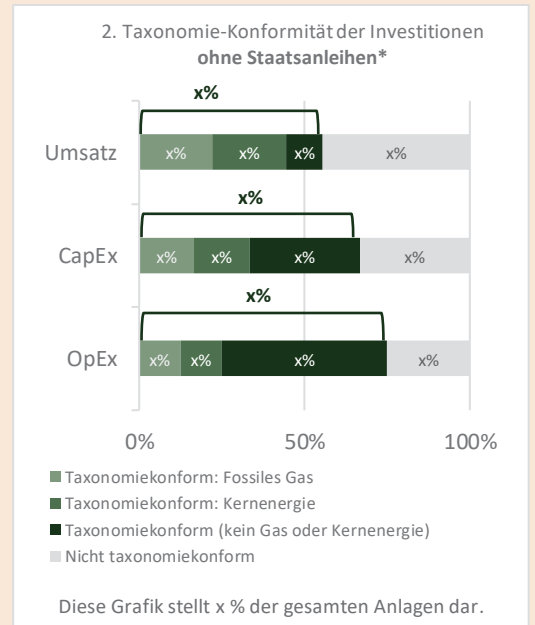
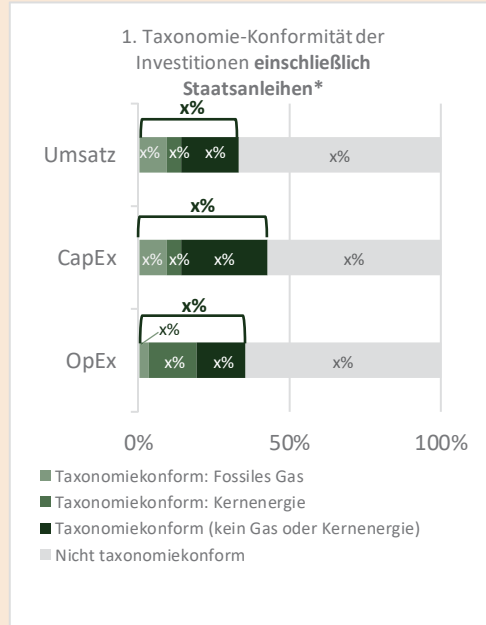
- Ja:
 In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

¹ Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittentenanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in seine internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Er strebte danach, konstruktiven Dialogen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – das Portfolio verwendet keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Global High Yield SDG Engagement Fund (das „Portfolio“)

Unternehmenskennung: 549300YE6BLJU5JCDI13

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 30,1* % an nachhaltigen Investitionen**

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben**, aber **keine nachhaltigen Investitionen** getätigt

*Das Portfolio führte zum 2. August 2023 eine Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen von 10 % ein. Die Angaben zu nachhaltigen Investitionen in dieser periodischen Berichtsvorlage wurden daher auf Grundlage des Durchschnitts aus den Werten zum Ende des dritten und vierten Quartals 2023 (als die einzigen Quartalsenden nach Einführung der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen) erstellt. Die Zahlen zu den nachhaltigen Investitionen sind, bedingt durch die uneinheitlichen Bezugszeiträume, nicht in der Tabelle zur Vermögensallokation enthalten.

**Weitere Einzelheiten zur Vermögensallokation des Portfolios (einschließlich des Engagements bei nachhaltigen Investitionen) finden Sie nachfolgend unter der Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“.

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „Bezugszeitraum“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen,

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Das Portfolio bewarb die UN-Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDGs“), indem es sich zum Ziel setzt, mit 100 % der Unternehmensemittenten direkt in Kontakt zu treten (innerhalb von 12 Monaten im Anschluss an den Kauf der von dem Unternehmensemittenten begebenen Wertpapiere). Der Sub-Investment-Manager hat Leistungskennzahlen („KPIs“) für Unternehmensemittenten festgelegt, die auf die SDGs ausgerichtet waren und sich auf die Produkte, Dienstleistungen, betriebliche Tätigkeiten oder Prozesse der Emittenten bezogen, mit dem Ziel, ein positives Ergebnis für die Umwelt und/oder die Gesellschaft zu erzielen. Der Sub-Investment-Manager legte in erster Linie in Emittenten von Unternehmen an, die in der Lage und bereit waren, sich mit ihm über spezifische, auf die SDGs ausgerichtete KPIs auszutauschen.

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO₂-Fußabdrucks*, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, Recycling-Praktiken und -Trends, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen zur Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „NB- ESG-Quotient“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („NB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentrierte, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen werden. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen. Jedes Sektorkriterium wurde unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistentams für das Portfolio genutzt wurde.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergriff, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Des Weiteren war der Sub-Investment-Manager bestrebt, einen konstruktiven Dialog mit 100 % der Unternehmensemittenten Vorrang zu priorisieren.

Der Bezugszeitraum ist ein Durchschnitt der vier Kalenderquartalsenden.

| Bezugszeitraum | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | 58 | 1-100 | 100 % |
| Daten von Dritten | 5,7 | 0-10 | |

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 das niedrigste und 100 das höchste Rating darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Berichterstattung über die Zusammenarbeit:

Wie oben erwähnt, trug der Sub-Investment-Manager zur Erreichung der SDGs bei, indem er sich bemühte, mit 100 % der Unternehmensemittenten in Kontakt zu treten (innerhalb von 12 Monaten im Anschluss an den Kauf der von dem Unternehmensemittenten begebenen Wertpapiere).

Im Bezugszeitraum wurde mit 100 % der Unternehmensemittenten Kontakt aufgenommen und/oder auf sie eingewirkt, um Treffen zu vereinbaren, doch kam es nur bei 96 % der Unternehmensemittenten zu einem Engagement. Der Sub-Investment-Manager betrachtet diese zusätzliche Zusammenarbeit als mehr als nur eine Interaktion. Weitere Einzelheiten finden Sie in der Neuberger Berman Stewardship and Engagement Policy [hier](#).

Der Sub-Investment-Manager hat nachfolgend eine Zusammenfassung seiner Bemühungen zur Einflussnahme während des Bezugszeitraums beigefügt.

| |
|--|
| Der Sub-Investment-Manager trat während des Bezugszeitraums mit 296 im Portfolio gehaltenen Unternehmen in Kontakt. |
| 55 % dieser Dialoge des Sub-Investment-Managers waren direkte Einzelgespräche (entweder per Fernzugriff oder als persönliches Gespräch). |
| 51 % der Gespräche des Sub-Investment-Managers fanden mit Mitarbeitern und Mitarbeiterinnen der CEO-/CFO-Ebene statt. |

15 der insgesamt 17 UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, „SDG“) wurden vom Sub-Investment-Manager während seiner Zusammenarbeit mit den Unternehmen abgedeckt.

26 % der Unternehmen, mit denen im Bezugszeitraum zusammengearbeitet wurde, haben das Ziel dieser Mitwirkung entweder vollständig erreicht oder teilweise Maßnahmen zur Erreichung ihres Ziels ergriffen.

Weitere Informationen über die Einflussnahme durch den Sub-Investment-Manager finden sich in der Bericht des Portfolios über die Zusammenarbeit [hier](#).

3. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmensemittenten gemessen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und Chancen durch den Klimawandel pro Emission und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit eine Emission durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 11,9 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 54 %, was einem Durchschnitt der CVaR-Abdeckung über die vier Kalenderquartalsenden hinweg entspricht.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

4. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der

Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Des Weiteren investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen. Das Portfolio durfte keine Wertpapiere von Emittenten kaufen, die an der Herstellung von Tabakprodukten wie Zigarren, Zigaretten, E-Zigaretten, rauchfreiem Tabak, auflösbarem Tabak und Kautabak beteiligt waren. Dies schloss auch Emittenten ein, die Rohabakblätter anbauen oder verarbeiten.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlage des Portfolios).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. Der NB-ESG-Quotient

| | NB-ESG-Quotient-Rating | Rating der Daten durch externe Anbieter | Kombinierte Abdeckung |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| Bereich | 1-100 | 0-10 | 0-100 % |
| Bezugszeitraum 2022 | 68 | 5,6 | 100 % |
| Bezugszeitraum 2023 | 58 | 5,7 | 100 % |

Das NB-ESG-Quotient-Rating hat sich im Vergleich zum Vorjahr verschlechtert, und das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich verbessert. Dies ist unter Umständen auf eine Verbesserung bei den einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten gemäß externem Datenanbieter oder auf Differenzen im von dem Anbieter bereitgestellten externen Rating des Emittenten zurückzuführen.

2. Berichterstattung über die Zusammenarbeit

| | Unternehmen, mit denen zusammen-gearbeitet wurde | % der Dialoge waren direkte Einzelgespräche (entweder per Fernzugriff oder als persönliches Gespräch) | % der Dialoge erfolgten mit Mitarbeiter/innen auf CEO/CFO-Ebene | Anzahl der abgedeckten SDGs (von 17) | % der Unternehmen, mit denen zusammen-gearbeitet wurde, haben das Ziel dieser Mitwirkung entweder vollständig erreicht oder teilweise Maßnahmen zur Erreichung ihres Ziels ergriffen. |
|----------------------------|--|---|---|--------------------------------------|---|
| Bezugszeitraum 2022 | 207 | 61 % | 50 % | 15 | 20 % |
| Bezugszeitraum 2023 | 296 | 55 % | 51 % | 15 | 26 % |

3. CVaR

| | CVaR | Abdeckung |
|----------------------------|---------|-----------|
| Bezugszeitraum 2022 | -9,1 % | 53 % |
| Bezugszeitraum 2023 | -11,9 % | 54 % |

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die CVaR-Prognose aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmensemittenten und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verändert.

4. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

| | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|-------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0 |
| Bezugszeitraum 2023 | 0 |

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es während des Bezugszeitraums kein nachhaltiges Anlageziel. Seit dem 2. August 2023 hat sich das Portfolio dazu verpflichtet, mindestens 10 % nachhaltige Investitionen zu halten. Die nachhaltigen Investitionen bewarben die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat (wie nachstehend erläutert) und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Emittenten, um festzustellen, ob der Emittent einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Emittenten auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Sub-Investment-Manager überprüfte die Emittenten auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Emittenten diese Prüfung bestanden haben, hat der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag des Emittenten zur Wirtschaft gemessen.

Der Sub-Investment-Manager erfasste dies auf zwei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbaren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Seit dem 2. August 2023 wendet der Sub-Investment-Manager seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigen. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „PAIs“):

| PAIs | |
|-------------------------------|--|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgasemissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird |

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.

| | |
|-----------------------------------|--|
| | <p>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind</p> <p>PAI 5 - Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen</p> <p>PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren</p> |
| <i>Biodiversität</i> | PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken |
| <i>Wasser</i> | PAI 8 - Emissionen in Wasser |
| <i>Abfall</i> | PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | <p>PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen</p> <p>PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen</p> <p>PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle</p> <p>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen</p> <p>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)</p> |

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte ferner Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen und investierte nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Emittenten, die quantitative und qualitative Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI festgelegt wurden, unterschreiten;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Emittenten, wenn sie unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und

- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „*Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?*“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.
2. Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| PAIs auf Produktebene | |
|-----------------------------------|--|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgas-emissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die o. g. PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023.

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|---|--|-------------------------|----------|
| LORCA TELECOM BONDCO SAU RegS | J – Information und Kommunikation | 0,7 % | Spanien |
| ASCENT RESOURCES/ARU FIN 144A | B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden | 0,6 % | USA |
| GTCR AP FINANCE INC 144A | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 0,6 % | USA |
| AMERICAN AIRLINES INC 144A | H – Verkehr und Lagerung | 0,6 % | USA |
| PRIME SECURITY SERVICES BORROWER L 144A | N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 0,5 % | USA |
| VERISURE HOLDING AB RegS | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 0,5 % | Schweden |
| BLACKSTONE CQP HOLDCO LP 144A | N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 0,5 % | USA |
| SOLARIS MIDSTREAM HOLDINGS LLC 144A | H – Verkehr und Lagerung | 0,5 % | USA |
| PRESIDIO HOLDING INC 144A | J – Information und Kommunikation | 0,5 % | USA |
| ON ASSIGNMENT INC 144A | J – Information und Kommunikation | 0,5 % | USA |
| NOVELIS SHEET INGOT GMBH RegS | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 0,5 % | USA |
| FRONTIER COMMUNICATIONS CORP 144A | J – Information und Kommunikation | 0,4 % | USA |
| SUMMIT MIDSTREAM HOLDINGS LLC 144A | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 0,4 % | USA |
| IRON MOUNTAIN INC 144A | L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 0,4 % | USA |
| MOZART DEBT MERGER SUB INC 144A | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 0,4 % | USA |



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

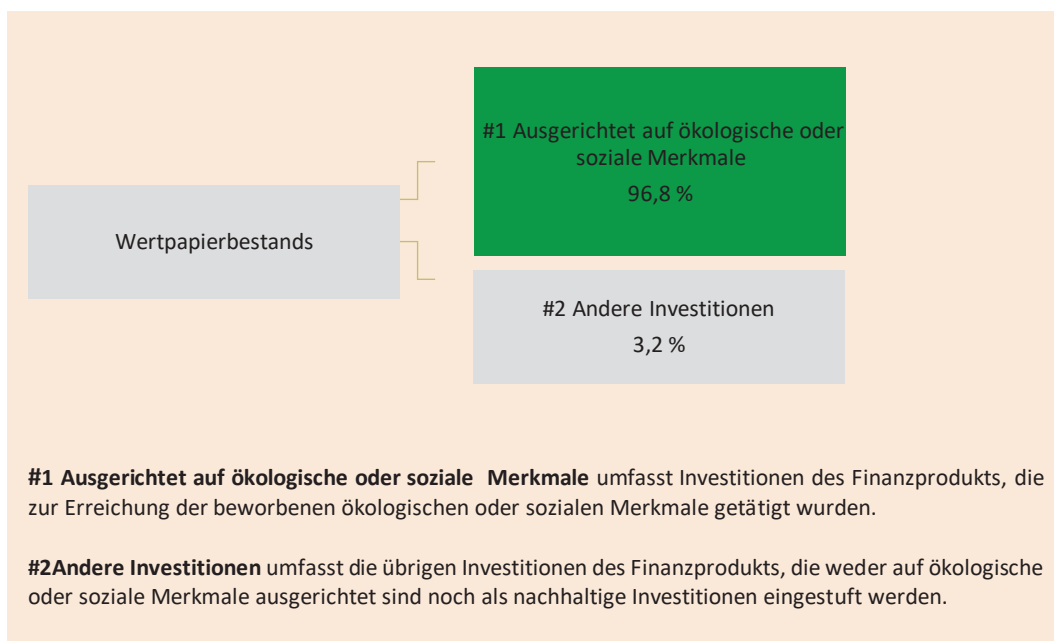
Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 96,8 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio führte zum 2. August 2023 eine Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen von 10 % ein. Die Angaben zu nachhaltigen Investitionen in diesem periodischen Bericht wurden daher auf Grundlage der Portfoliobestände als Durchschnitt zum dritten und vierten Quartalsende des Bezugszeitraums (als die einzigen Quartalsenden nach Einführung der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen) erstellt. Das Portfolio hielt 30,1 % an nachhaltigen Investitionen.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 3,2 % an „sonstigen Investitionen“.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Emittenten

im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet, mit Ausnahme der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen. In diesem Falle wurden die Daten lediglich für diesen Bezugszeitraum auf Grundlage des Durchschnitts zum Ende des dritten und vierten Quartals berechnet.



Der prozentuale Anteil der nachhaltigen Investitionen als Durchschnitt des dritten und vierten Quartals 2023 beträgt 30,1 %. Darin enthalten sind 19,6 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind, und 10,5 % an sozial nachhaltigen Investitionen. Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Bildung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|--|-------------------------|
| B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden | 5,8 % |
| C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 17,0 % |
| D – Energieversorgung | 3,4 % |
| E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen | 0,7 % |
| F – Baugewerbe/Bau | 2,0 % |
| G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 5,4 % |
| H – Verkehr und Lagerei | 7,3 % |
| I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie | 1,2 % |
| J – Information und Kommunikation | 12,9 % |

| | |
|--|--------|
| K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 29,3 % |
| L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 2,8 % |
| M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Tätigkeiten | 1,2 % |
| N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 5,7 % |
| Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen | 2,9 % |
| R – Kunst, Unterhaltung und Erholung | 1,0 % |
| S – Sonstige Dienstleistungen | 0,1 % |
| Keine | 1,3 % |



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

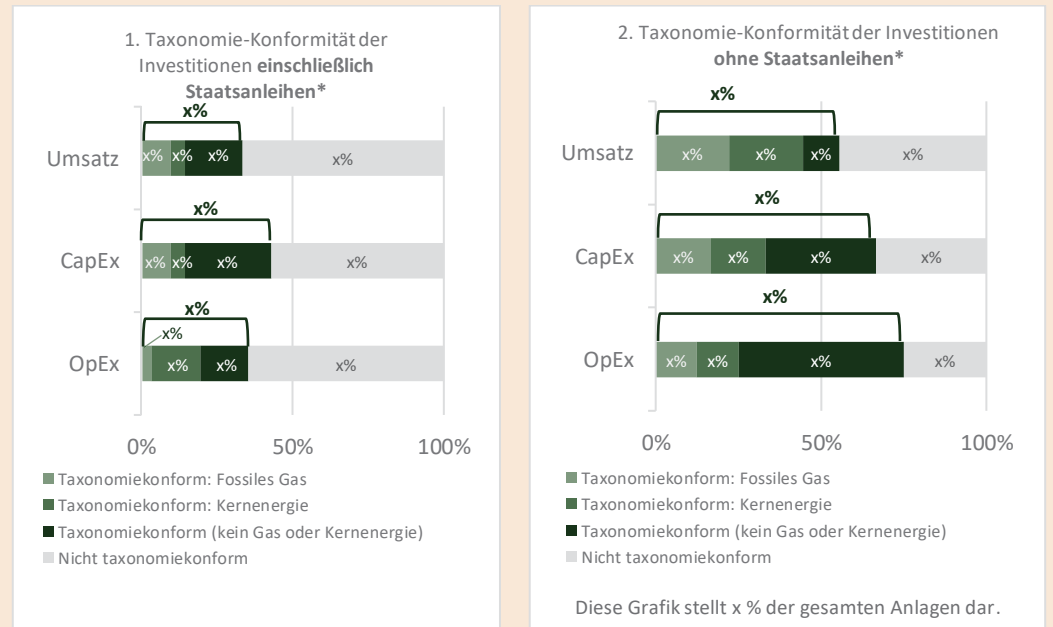
● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

- Ja:
- In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

¹ Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Das Portfolio führte zum 2. August 2023 eine Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen von 10 % ein. Die Angaben zu nachhaltigen Investitionen in dieser periodischen Berichtsvorlage wurden daher auf Grundlage des Durchschnitts zum dritten und vierten Quartalsende des Bezugszeitraums (als die einzigen Quartalsenden nach Einführung der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen) erstellt. Das Portfolio hielt 19,6 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, das nicht mit der EU-Taxonomie konform ist.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Das Portfolio führte zum 2. August 2023 eine Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen von 10 % ein. Die Angaben zu nachhaltigen Investitionen in dieser periodischen Berichtsvorlage wurden daher auf Grundlage des Durchschnitts zum dritten und vierten Quartalsende des Bezugszeitraums (als die einzigen Quartalsenden nach Einführung der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen) erstellt. Das Portfolio hielt 10,5 % an sozial nachhaltigen Investitionen.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager war der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben,

verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittenteanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses.

Dieses Programm konzentrierte sich auf persönliche Treffen und Telefonkonferenzen, um die ESG-Risiken und -Chancen zu verstehen und die gute

Unternehmensführung der Emittenten zu bewerten. Im Rahmen der direkten Zusammenarbeit hat der Sub-Investment-Manager Ziele festgelegt, welche Ziele die Emittenten erreichen sollten. Diese Ziele sowie die Fortschritte der Emittenten im Hinblick auf diese Ziele wurden vom Sub-Investment-Manager mit Hilfe eines internen Systems von NB zur Nachverfolgung der Mitwirkung erfasst und überwacht (weitere Einzelheiten sind dem obigen Abschnitt über die Mitwirkung zu entnehmen).

Das Portfolio bewarb ökologische und soziale Merkmale. Zugleich leistete es einen Beitrag zur Erreichung der SDGs, indem darauf abgezielt wurde, direkt mit allen Unternehmensemittenten (innerhalb von zwölf Monaten nach Kauf der durch den Unternehmensemittenten begebenen Wertpapiere) zusammenzuarbeiten. Die Mitwirkung erfolgte in erster Linie über persönliche Treffen und Gespräche sowie durch Festlegung von wesentlichen Leistungsindikatoren (KPIs), die auf die SDGs ausgerichtet sind und auf die Produkte, Dienstleistungen, den Geschäftsbetrieb oder die Prozesse der Emittenten Bezug nahmen. Damit sollte ein positives Ergebnis bezogen auf die Umwelt und/oder Gesellschaft erzielt werden. Der Sub-Investment-Manager legte in erster Linie in Emittenten von Unternehmen an, die in der Lage und bereit waren, sich mit ihm über spezifische, auf die SDGs ausgerichtete KPIs auszutauschen. Der Sub-Investment-Manager beurteilte vierteljährlich die Fortschritte der im Portfolio vertretenen Emittenten gegenüber den festgelegten KPIs. Diese direkte Mitwirkung bei Unternehmensemittenten war wesentlicher Bestandteil des Anlageprozesses und ausschlaggebend für den Portfoliobeitrag zur Erreichung der SDGs.

Der Sub-Investment-Manager nutzte ein hausinternes Instrument, um im Vorfeld einer Anlage die Wahrscheinlichkeit auf Erfolg bei der Mitwirkung gegenüber einem Emittenten festzustellen (der „**Mitwirkungspotenzial-Indikator**“). Der Mitwirkungspotenzial-Indikator bietet auf einer Skala von 1–5 eine systematische Bewertung der Bereitschaft und Fähigkeit eines Emittenten, mit dem Sub-Investment-Manager zu den SDGs zusammenzuarbeiten. Ein Emittent, der beispielsweise als nicht bereit oder fähig zur Zusammenarbeit eingestuft wurde, erhielt einen Mitwirkungspotenzial-Indikator von „1“, während ein Emittent, der zur Zusammenarbeit bereit war, um ein Vorreiter bei der Unterstützung der SDGs zu werden, mit einem Mitwirkungspotenzial-Indikator von „5“ bewertet wurde. Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Emittenten mit einem Mitwirkungspotenzial-Indikator von weniger als „2“. Mit dem Mitwirkungspotenzial-Indikator wurden neben den finanziellen Beschränkungen für den Emittenten verschiedene Faktoren berücksichtigt, darunter die Bedeutung der SDGs im Geschäftsbetrieb des Emittenten, die Offenlegungspraktiken des Emittenten und die Beziehung des Sub-Investment-Managers zum Emittenten.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.



Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
k.A.
 - **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
k.A.
 - **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
k.A.
-

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Global Investment Grade Credit Fund (das „Portfolio“)

Unternehmenskennung: 549300TIVE0UW3FSBE51

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Nein

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [here](#).

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO₂-Fußabdrucks, Umweltmanagement, Treibhausgasemissionen („**THG**“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, Gelegenheiten für erneuerbare Energien, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikoübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen in der Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**MB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistenteam für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Emittenten ein, die einen schlechten NB-ESG-Quotienten aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachen) zu erreichen.

| Bezugszeitraum | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|--------------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | 61 | 1-100 | 100 % |
| Daten von Dritten | 6,8 | 0-10 | |

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmensemittenten gemessen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und Chancen durch den Klimawandel pro Emission und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit eine Emission durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 3,3 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 68 %. Diese Deckung

ist ein Durchschnitt der CVaR-Abdeckung über die vier Kalenderquartalsenden hinweg.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

| | NB-ESG-Quotient-Rating | Rating der Daten durch externe Anbieter | Kombinierte Abdeckung |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| Bereich | 1-100 | 0-10 | 0-100 % |
| Bezugszeitraum 2022 | 62 | 6,7 | 100 % |
| Bezugszeitraum 2023 | 61 | 6,8 | 100 % |

Das NB-ESG-Quotient-Rating hat sich im Vergleich zum Vorjahr verschlechtert, und das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich verbessert. Dies ist unter Umständen auf eine Verbesserung bei den einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten gemäß externem Datenanbieter oder auf Differenzen im von dem Anbieter bereitgestellten externen Rating des Emittenten zurückzuführen.

2. CVaR

| | CVaR | Abdeckung |
|----------------------------|-------------|------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | -3,4 % | 71 % |
| Bezugszeitraum 2023 | -3,3 % | 68 % |

Der durch die CVaR prognostizierte Verlust hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmensemittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

| | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|--------------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0 |
| Bezugszeitraum 2023 | 0 |

- ***Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?***

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| PAIs auf Produktebene | |
|-----------------------------------|--|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgas-emissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|------------------------------------|--|-------------------------|----------------|
| UNITED AIR 2020-1 A PTT | H - Verkehr und Lagerung | 1,5 % | USA |
| WEC ENERGY GROUP INC | D – Energieversorgung | 1,3 % | USA |
| HSBC HOLDINGS PLC | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 1,3 % | Großbritannien |
| ATHENE GLOBAL FUNDING 144A | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 1,0 % | USA |
| JP MORGAN CHASE & CO | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 1,0 % | USA |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 1,0 % | USA |
| BARCLAYS PLC | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 1,0 % | Großbritannien |
| MARATHON PETROLEUM CORP | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 0,9 % | USA |
| DELL INTERNATIONAL LLC | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 0,9 % | USA |
| SOUTHERN ELECTRIC GENERATING CO | D – Energieversorgung | 0,9 % | USA |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 0,8 % | Großbritannien |
| DOMINION ENERGY INC | D – Energieversorgung | 0,8 % | USA |
| CITIGROUP INC | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 0,8 % | USA |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 0,8 % | Belgien |
| F&G GLOBAL FUNDING RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 0,8 % | USA |



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

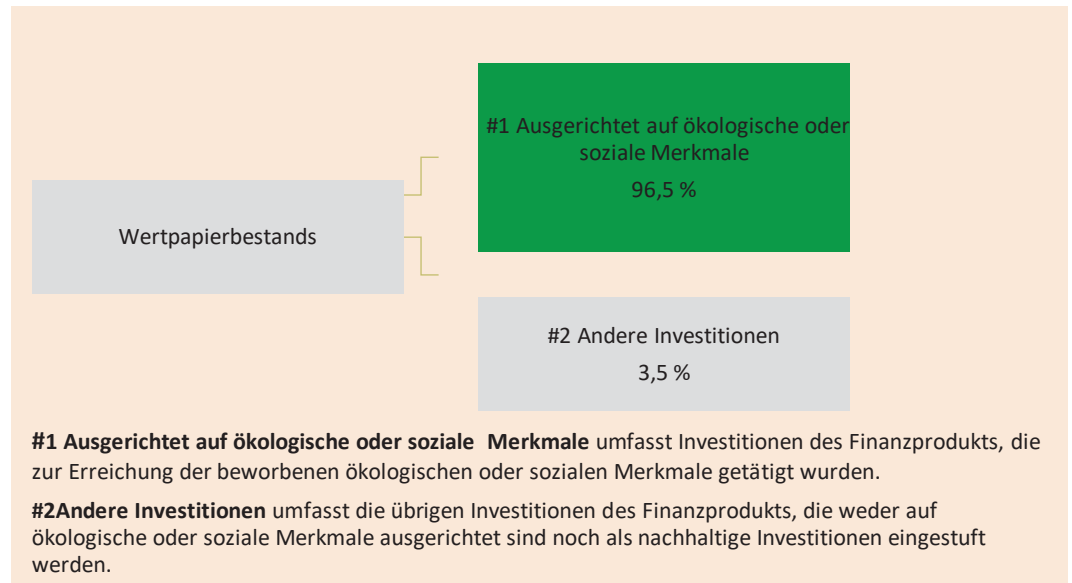
Wie sah die Vermögensallokation aus?

Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 96,5 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.

Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 3,5 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder Dritten beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|--|-------------------------|
| B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden | 2,1 % |
| C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 14,3 % |
| D – Energieversorgung | 9,2 % |
| E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen | 0,7 % |
| G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 2,2 % |
| H - Verkehr und Lagerei | 5,2 % |
| I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie | 0,7 % |
| J – Information und Kommunikation | 13,0 % |
| K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 45,5 % |
| L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 2,5 % |
| M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen | 1,9 % |
| N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 0,8 % |
| O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 0,5 % |
| Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen | 0,8 % |
| U – Extraterritoriale Organisationen und Körperschaften | 0,5 % |
| Keine | 0,2 % |

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

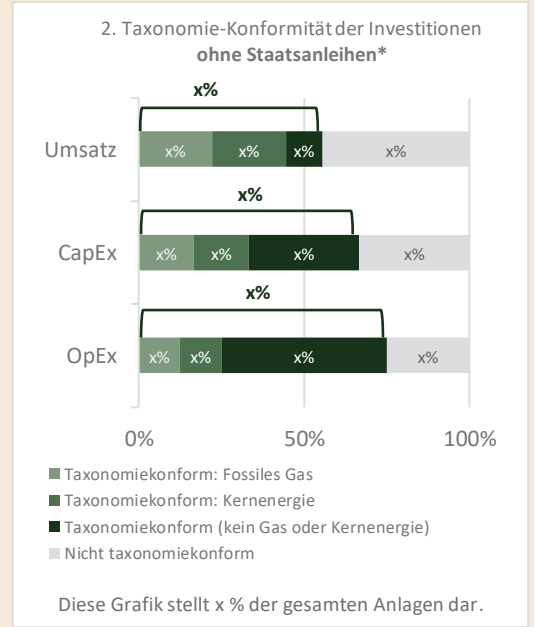
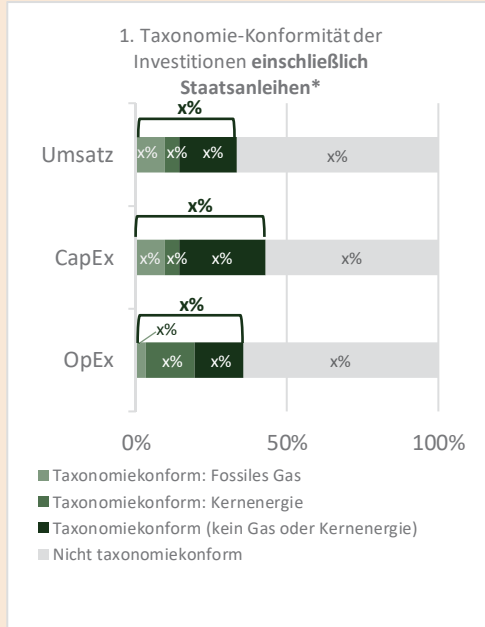
- Ja:
 In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

¹ Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittenteanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in seine internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Er strebte danach, konstruktiven Dialogen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

k.A.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

k.A.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

k.A.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund (das „Portfolio“)

Unternehmenskennung: 549300ZNZZ2YDVTNRE14

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Nein

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO₂-Fußabdrucks, Umweltmanagement, Treibhausgasemissionen („**THG**“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, Gelegenheiten für erneuerbare Energien, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikoübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen in der Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses haben der Manager und der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**MB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Manager und Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergriff, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühten sich der Manager und der Sub-Investment-Manager einem konstruktiven Dialog mit Emittenten mit einer schlechten Bewertung des NB-ESG-Quotienten Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

| Bezugszeitraum | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | 62 | 1-100 | 73 % |
| Daten von Dritten | 6,2 | 0-10 | |

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet. Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmensemittenten gemessen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und Chancen durch den Klimawandels pro Emission und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit eine Emission durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 4,5 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Managers und des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Manager und der Sub-Investment-Manager der Teilstrategie über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 23 %, was einem Durchschnitt der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale entspricht.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagten der Manager und der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen. Darüber hinaus schloss das Portfolio Emittenten von Unternehmensanleihen aus den Schwellenländern aus, die in der Tabakindustrie tätig und an Kinderarbeit beteiligt waren.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich haben der Manager und der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise ihrer Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager erörterten und diskutierten die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund ihres eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlage des Portfolios).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

| | NB-ESG-Quotient-Rating | Rating der Daten durch externe Anbieter | Kombinierte Abdeckung |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| Bereich | 1-100 | 0-10 | 0-100 % |
| Bezugszeitraum 2022 | 61 | 5,7 | 80 % |
| Bezugszeitraum 2023 | 62 | 6,2 | 73 % |

Die Bewertung des NB-ESG-Quotienten hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

Das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen sowie auf potenzielle Änderungen oder Unterschiede im externen Rating des Emittenten.

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die kombinierte Abdeckung des NB ESG-Quotienten und des externen Ratings aufgrund von Veränderungen bei den gehaltenen Emittenten und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verlagert.

2. CVaR

| | CVaR | Abdeckung |
|----------------------------|-------------|------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | -4,2 % | 24 % |
| Bezugszeitraum 2023 | -4,5 % | 23 % |

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die CVaR-Prognose aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmensemittenten und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verändert.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

| | Gesamtzahl der Verstöße |
|---------------------|-------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0 |
| Bezugszeitraum 2023 | 0 |

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

— **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

— **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, und der Manager und der Sub-Investment-Manager waren nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager und den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten in Bezug auf die Nachhaltigkeitsfaktoren die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 1 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für Unternehmensemittenten (die „**PAIs für Unternehmensemittenten**“), und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 2 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für staatliche Emittenten (die „**staatliche PAIs**“) (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“):

| Teil 1 – PAIs für Unternehmensemittenten | |
|--|--|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgas-emissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

| Teil 2 – staatliche PAIs | |
|--------------------------|---|
| Umwelt | PAI 15 - THG-Emissionsintensität |
| Soziales | PAI 16 - Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbareren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager und den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und

Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|--|---|-------------------------|----------------|
| NEW ZEALAND (GOVERNMENT OF) RegS | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 4,6 % | Neuseeland |
| MEX BONOS DE DESARROLLO | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 2,1 % | Mexiko |
| TREASURY NOTE (20LD) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,2 % | USA |
| NGG FINANCE PLC RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 1,1 % | Großbritannien |
| CHINA PEOPLES REPUBLIC OF (GOVERNMENT) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,1 % | China |
| PORTUGAL (REPUBLIC OF) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 0,9 % | Portugal |
| CHINA PEOPLES REPUBLIC OF (GOVERNMENT) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 0,9 % | China |
| MEXICO (UNITED MEXICAN STATES) (GO) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 0,8 % | Mexiko |
| TREASURY NOTE | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 0,8 % | USA |

| | | | |
|-----------------------------------|---|-------|------------|
| POLAND (REPUBLIC OF) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 0,8 % | Polen |
| STACR_18-DNA1 M2 | k.A. | 0,7 % | USA |
| FNMA 30YR UMBS | k.A. | 0,7 % | k.A. |
| STACR 2017-DNA1 M2 | k.A. | 0,7 % | USA |
| INDONESIA (REPUBLIC OF) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 0,7 % | Indonesien |
| ELECTRICITE DE FRANCE SA MTN RegS | D – Energieversorgung | 0,7 % | Frankreich |

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.



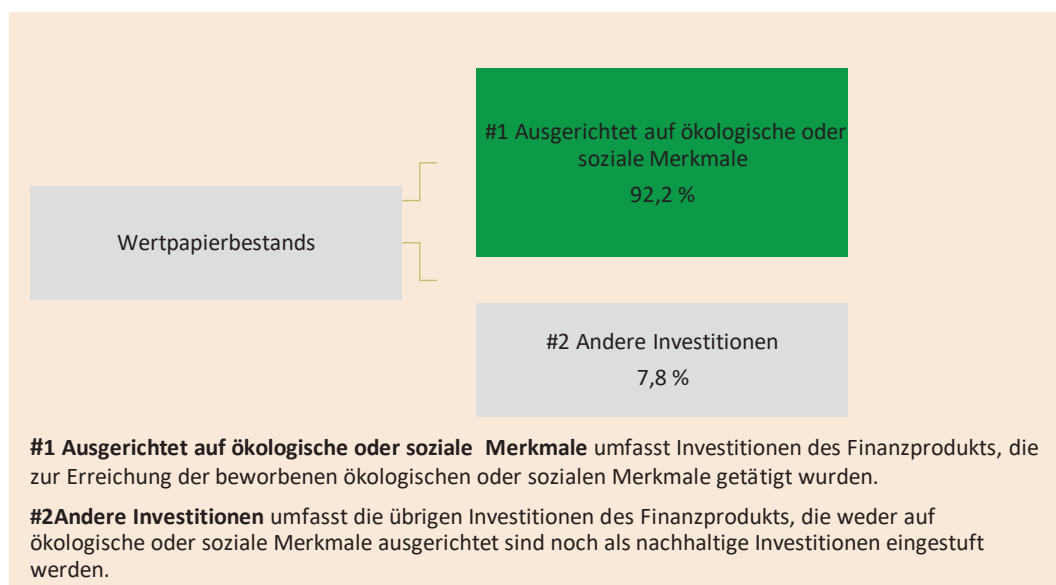
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 65 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 92,2 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 35 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 7,8 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berechneten den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager und der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatten. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Bildung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|--|-------------------------|
| B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden | 0,7 % |
| C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 7,6 % |
| D – Energieversorgung | 1,9 % |
| E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen | 0,3 % |
| F – Baugewerbe/Bau | 0,1 % |
| G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 2,2 % |
| H - Verkehr und Lagerei | 1,3 % |
| I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie | 0,0 % |
| J – Information und Kommunikation | 5,5 % |
| K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 18,9 % |
| L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 1,6 % |
| M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen | 0,1 % |
| N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 1,5 % |
| O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 30,6 % |
| P – Erziehung und Unterricht | 0,2 % |
| Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen | 0,1 % |
| R – Kunst, Unterhaltung und Erholung | 0,7 % |
| U – Exterritoriale Organisationen und Körperschaften | 0,6 % |
| Keine | 26,1 % |

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung: obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichte Tätigkeiten wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager können bestätigen, dass das Portfolio in Investitionen investiert hat, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager und der Sub-Investment-Manager werden das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

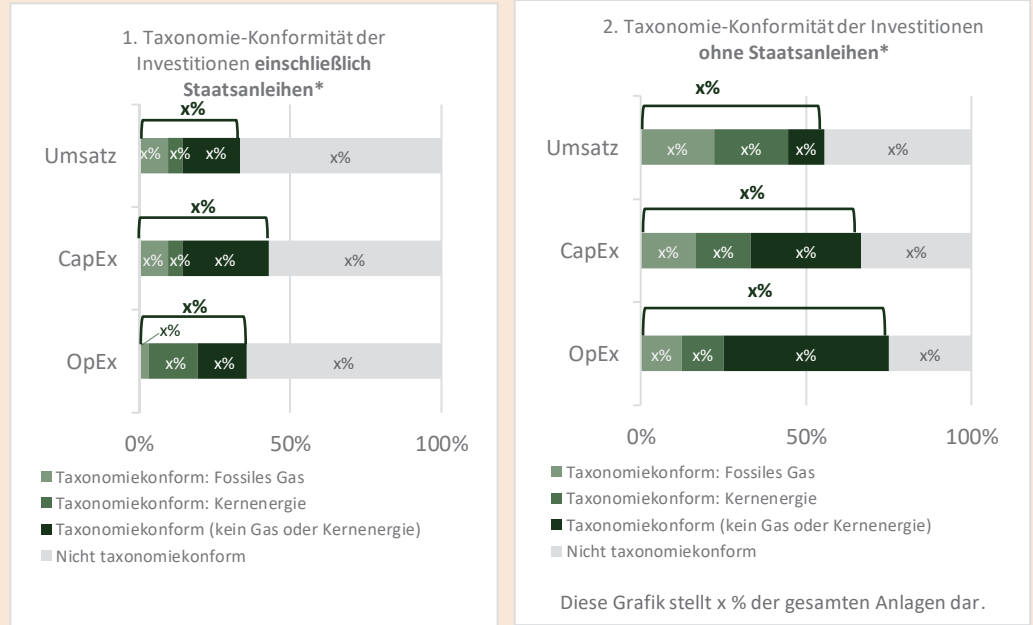
- Ja:
- In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

¹ Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Anlagen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate, Wertpapiere der Kategorie „To be Announced“ [„TBA“] oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert sind, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen einzustufen waren.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager und der Sub-Investment-Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachteten, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen, verhinderten und sie sicherstellen, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager wendeten bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager verstehen unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Managers und des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers und des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager und vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in seine internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager engagierten sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Er strebte danach, konstruktiven Dialogen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachtete. Der Manager und der Sub-Investment-Manager betrachteten diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil ihres Anlageprozesses. Die Fortschritte bei der Einbindung wurden vom Manager und dem Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen

Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Global Real Estate Securities Fund (das „Portfolio“)

Unternehmenskennung: 549300JYOIU4VRI67006

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Nein

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „Bezugszeitraum“). Alle Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnitt der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („THG“)*, Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, und Materialbeschaffung.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Anreize für Mitarbeiter und Risikobereitschaft, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsnormen in der Lieferkette und Vielfalt und Integration der Belegschaft.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet. Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („MB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteten ESG-Daten erstellt. Ergänzend kommen interne qualitative Analysen hinzu, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistenteam des Sub-Investment-Managers genutzt wird. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergreift, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühte sich der Sub-Investment-Manager, konstruktiven Dialogen bei Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Bezugszeitraum | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|-----------------|-------------------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | ES: B G: 1,8 | ES: A-D G: 1-4 | 98 % |
| Daten von Dritten | 6,5 | 0-10 | |

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Im Hinblick auf die NB-ESG-Quotient-Ratings der Aktienemittenten werden für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale („ES“) die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („G“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und der Chancen durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 24,6 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 96 %. Diese Deckung

ist ein Durchschnitt der CVaR-Abdeckung über die vier Kalenderquartalsenden hinweg.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren). Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischen Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen. Der Sub-Investment-Manager untersagte Investitionen in Emittenten, die private Gefängnisse besitzen, betreiben oder überwiegend wesentliche Dienstleistungen für diese erbringen. Die Gründe sind die erheblichen sozialen Kontroversen, die Reputationsrisiken, die Abhängigkeit von der Politik der Justizministerien und der Umstand, dass diese Einrichtungen nicht ohne weiteres für andere Zwecke umgestaltet werden können.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

| | NB-ESG-Quotient-Rating | Rating der Daten durch externe Anbieter | Kombinierte Abdeckung |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| Bereich | ES: A-D G: 1-4 | 0-10 | 0-100 % |
| Bezugszeitraum 2022 | ES: B G: 1,7 | 6,4 | 100 % |
| Bezugszeitraum 2023 | ES: B | 6,5 | 98 % |

| | | | |
|--|--------|--|--|
| | G: 1,8 | | |
|--|--------|--|--|

Das ES-Rating des NB-ESG-Quotienten ist im Vergleich zum Vorjahr unverändert geblieben, das G-Rating des NB-ESG-Quotienten ist zurückgegangen. Die Bewertung der Daten Dritter hat sich verbessert. Dies ist unter Umständen auf Verbesserungen bei den einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmen gemäß externem Datenanbieter oder auf Differenzen des von dem Anbieter bereitgestellten externen Rating des Unternehmens zurückzuführen.

2. CVaR

| | CVaR | Abdeckung |
|----------------------------|---------|-----------|
| Bezugszeitraum 2022 | -15,9 % | 94 % |
| Bezugszeitraum 2023 | -24,6 % | 96 % |

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich der prognostizierte CVaR-Verlust aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmen und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios erhöht. Wie bereits erwähnt, kann die Szenarioanalyse als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken dienen, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

| | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|-------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0 |
| Bezugszeitraum 2023 | 0 |

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| PAIs auf Produktebene | |
|-----------------------------------|--|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgasemissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|------------------------------------|--|-------------------------|----------------|
| AMERICAN TOWER REIT CORP | L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 5,1 % | USA |
| PROLOGIS REIT INC | L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 4,7 % | USA |
| PUBLIC STORAGE REIT | L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 4,5 % | USA |
| CROWN CASTLE INC | N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 3,2 % | USA |
| EQUINIX REIT INC | J – Information und Kommunikation | 3,0 % | USA |
| UOL GROUP LTD | F – Baugewerbe/Bau | 2,9 % | Singapur |
| MITSUI FUDOSAN LTD | L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 2,8 % | Japan |
| REALTY INCOME REIT CORP | L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 2,7 % | USA |
| WELLTOWER INC | L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 2,4 % | USA |
| REGION GROUP STAPLED UNITS LTD | L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 2,4 % | Australien |
| KIMCO REALTY REIT CORP | L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 2,3 % | USA |
| SIMON PROPERTY GROUP REIT INC | L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 2,2 % | USA |
| VICI PPTYS INC | L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 2,2 % | USA |
| RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUS | L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 2,1 % | Kanada |
| SEGRO REIT PLC | L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 2,1 % | Großbritannien |



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

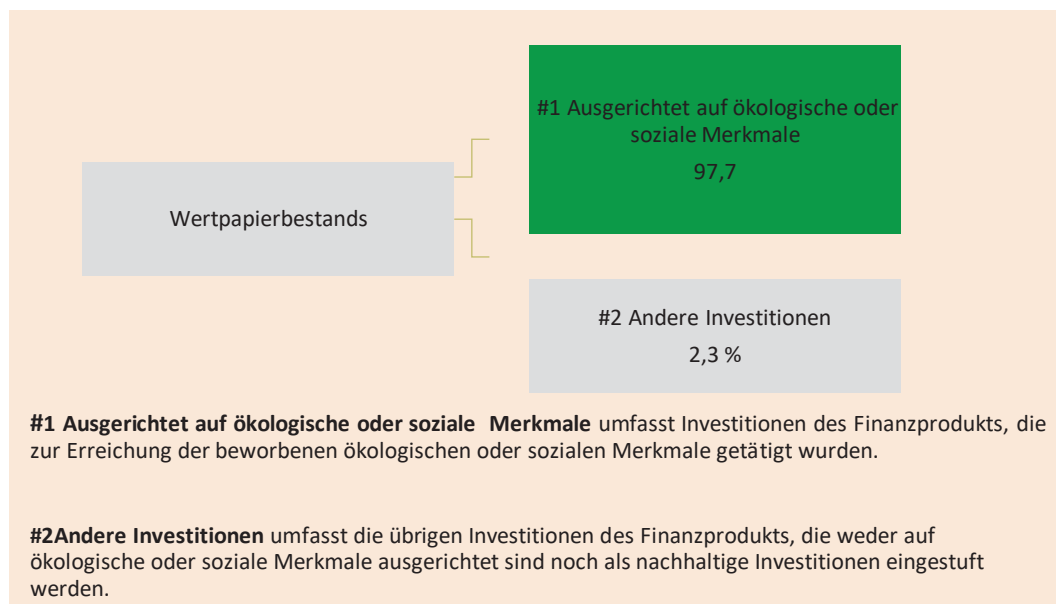
Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 97,7 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 2,3 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der

Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



● *In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?*

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|--|-------------------------|
| C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 1,6 % |
| F – Baugewerbe/Bau | 7,8 % |
| H - Verkehr und Lagerei | 0,7 % |
| J – Information und Kommunikation | 4,9 % |
| L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 81,8 % |
| N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 3,2 % |

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine 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?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

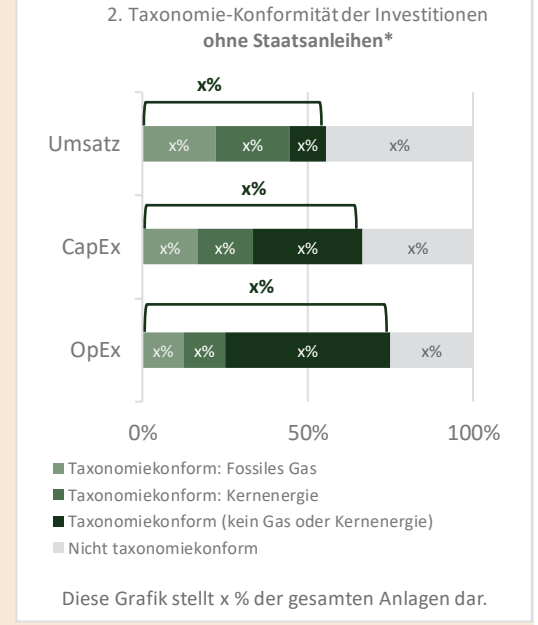
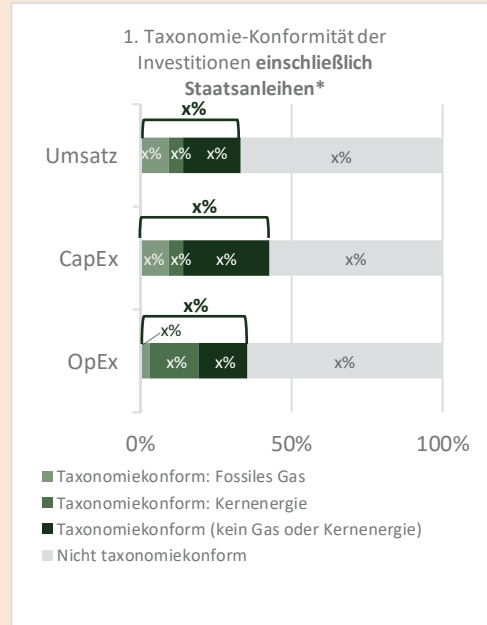
- Ja:
 In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

¹ Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte. Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittenteanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde herangezogen, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in seine Bewertung bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Global Sustainable Equity Fund (das „Portfolio“)

Unternehmenskennung: 549300XRT8BVEN8P0A74

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

- Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
 - in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Nein

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 60.1 %* an nachhaltigen Investitionen.

- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

*Weitere Einzelheiten zur Vermögensallokation des Portfolios (einschließlich des Engagements in nachhaltigen Investitionen) finden Sie nachfolgend unter der Frage „*Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?*“.

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („**THG**“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.

In dem Bestreben, das Portfolio auf ein Netto-Null-Ziel auszurichten, bewirbt der Manager die Verringerung des CO₂-Fußabdrucks des Portfolios in Bezug auf Scope-1-, Scope-2- und wesentliche Scope-3-Treibhausgasemissionen.¹ Es existiert kein jährliches Reduktionsziel. Stattdessen wird sich auf das Zwischenziel 2030 und das Netto-Null-Ziel 2050 konzentriert.

- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzmitteln und zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Anreize für Mitarbeiter und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsnormen in der Lieferkette, Vielfalt und Integration der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortungsvolles Marketing.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigte der Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**NB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteten ESG-Daten erstellt. Ergänzend kamen interne qualitative Analysen hinzu, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistenteam für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-

¹Scope-1-Emissionen sind direkte Emissionen aus Quellen, die sich im Besitz des Unternehmens befinden oder von ihm kontrolliert werden (z. B. Emissionen, die sich direkt durch die Geschäftsprozesse des Unternehmens oder durch Fahrzeuge im Besitz des Unternehmens ergeben). Scope-2-Emissionen sind indirekte Emissionen aus der Erzeugung von Strom, Dampf, Wärme und Kälte, die vom Unternehmen verbraucht werden. Scope-3-Emissionen sind alle anderen indirekten Emissionen, die in der Wertschöpfungskette eines Unternehmens anfallen (u. a. Emissionen aus den vom Unternehmen verbrauchten Produkten oder Dienstleistungen, aus der Entsorgung seiner Abfälle, aus dem Pendelverkehr seiner Mitarbeiter, aus dem Vertrieb und Transport seiner Produkte oder aus seinen Investitionen).

Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient- oder externes Rating aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachen) zu erreichen.

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Bezugszeitraum | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|-----------------|------------------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | ES: B G: 2,4 | ES:A-D G: 1-4 | 99 % |
| Daten von Dritten | 7,4 | 0-10 | |

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale („ES“) werden die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („G“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („CVaR“) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und der Chancen durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 5,0 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 99 %, was einem Durchschnitt der CVaR-Abdeckung über die vier Kalenderquartalsenden hinweg entspricht.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy und die Neuberger Berman Enhanced Sustainable Exclusion Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstößend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen. Das Portfolio hat nicht in Unternehmen investiert, die mehr als 5% ihrer Umsätze über Hersteller von Pelz, Spezialleder oder militärische Auftragnehmer erzielten. Darüber hinaus schloss das Portfolio Unternehmen aus dem Anlageuniversum aus, die an umstrittenen Tätigkeiten und Verhaltensweisen beteiligt waren, darunter Glücksspiele, Alkohol und Kernenergie. Ferner schloss das Portfolio Unternehmen aus, die in diktatorische Regime/große ESG-Kontroversen verwickelt waren, Unternehmen, die ein sehr schlechtes Verhalten in Bezug auf Umweltverschmutzung, Menschenrechtsfragen oder Governance-Kontroversen an den Tag legten, und Unternehmen, die in Bezug auf ESG nicht transparent waren oder bei ESG-Kennzahlen insgesamt sehr schlecht abschneiden.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

| | NB-ESG-Quotient-Rating | Rating der Daten durch externe Anbieter | Kombinierte Abdeckung |
|----------------------------|------------------------|---|-----------------------|
| Bereich | ES: A-D G: 1-4 | 0-10 | 0-100 % |
| Bezugszeitraum 2022 | ES: B G: 2,2 | 7,2 | 100 % |
| Bezugszeitraum 2023 | ES: B G: 2,4 | 7,4 | 99 % |

Das ES-Rating des NB-ESG-Quotienten ist im Vergleich zum Vorjahr unverändert geblieben, das G-Rating des NB-ESG-Quotienten hat sich verschlechtert und das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich verbessert. Dies ist unter Umständen auf Verbesserungen bei den einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmen gemäß externem Datenanbieter oder auf Differenzen des von dem Anbieter bereitgestellten externen Rating des Unternehmens zurückzuführen.

2. CVaR

| | CVaR | Abdeckung |
|----------------------------|------|-----------|
| Bezugszeitraum 2022 | -5 % | 99 % |
| Bezugszeitraum 2023 | -5 % | 99 % |

Die CVaR-Prognose ist im Vergleich zum Vorjahr unverändert geblieben.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

| | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|-------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0 |
| Bezugszeitraum 2023 | 0 |

● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat, wie nachstehend erläutert, und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Unternehmens, um festzustellen, ob das Unternehmen einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Unternehmens auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Manager überprüfte die Unternehmen auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Unternehmen dieser Prüfung standhielten, quantifizierte der Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag der Unternehmen zur Wirtschaft.

Der Manager erfasste dies auf zwei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDGs“).

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbaren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Der Manager wendete seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigen. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und auf Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Manager berücksichtigte bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „PAIs“):

| PAIs | |
|-------------------------------|--|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgasemissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind PAI 5 - Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren |
| <i>Biodiversität</i> | PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken |
| <i>Wasser</i> | PAI 8 - Emissionen in Wasser |
| <i>Abfall</i> | PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle |

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

| | |
|-----------------------------------|--|
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | <p>PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen</p> <p>PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen</p> <p>PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle</p> <p>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen</p> <p>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)</p> |
|-----------------------------------|--|

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Manager hat auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Der Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Manager bei der Feststellung, ob die durch das Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Unternehmen, die unter die vom Manager für jede PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Unternehmen, die unter die vom Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Manager) berücksichtigt.

Der Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „*Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?*“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.
2. Der Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| PAIs auf Produktebene | |
|-------------------------|---|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| Treibhausgas-emissionen | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |

| | |
|-----------------------------------|---|
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | <p>PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen</p> <p>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen</p> <p>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)</p> |
|-----------------------------------|---|

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel, die vom Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|------------------------------|--|-------------------------|----------------|
| MICROSOFT CORP | J – Information und Kommunikation | 8,3 % | USA |
| ALPHABET INC CLASS A | J – Information und Kommunikation | 5,8 % | USA |
| AMAZON COM INC | G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 5,1 % | USA |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 3,9 % | USA |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 3,3 % | USA |
| NETFLIX INC | J – Information und Kommunikation | 3,0 % | USA |
| 3I GROUP PLC | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 2,9 % | Großbritannien |
| NIKE INC CLASS B | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,8 % | USA |
| BAKKAFROST | A – Landwirtschaft, Forstwirtschaft und Fischerei | 2,7 % | Faröer Inseln |
| ADOBE INC | J – Information und Kommunikation | 2,6 % | USA |
| INTUIT INC | J – Information und Kommunikation | 2,6 % | USA |
| ASML HOLDING NV | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,5 % | Niederlande |

| | | | |
|--------------------------|--|-------|-------------|
| ESTEE LAUDER INC CLASS A | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,4 % | USA |
| ADYEN NV | J – Information und Kommunikation | 2,3 % | Niederlande |
| S&P GLOBAL INC | J – Information und Kommunikation | 2,3 % | USA |



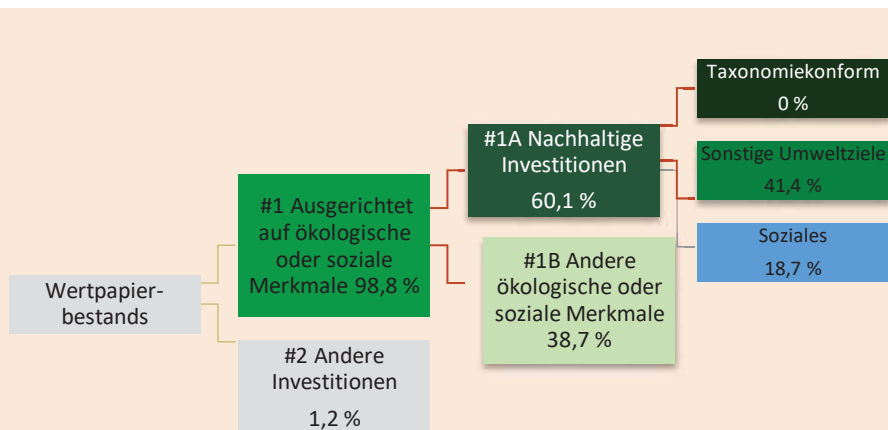
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 98,8 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio verpflichtet sich, mindestens 50 % an nachhaltigen Investitionen zu halten. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 60,1 % an nachhaltigen Investitionen.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 1,2 % „Andere Investitionen“.

Der Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige** Investitionen umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|--|-------------------------|
| A – Landwirtschaft, Forstwirtschaft und Fischerei | 2,8 % |
| C – Fertigung | 32,6 % |
| G – Handel, Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 8,9 % |
| I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie | 0,6 % |
| J – Information und Kommunikation | 30,9 % |
| K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 19,2 % |
| N – Verwaltungs- und Unterstützungsdienstleistungen | 5,0 % |



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine 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?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert²?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

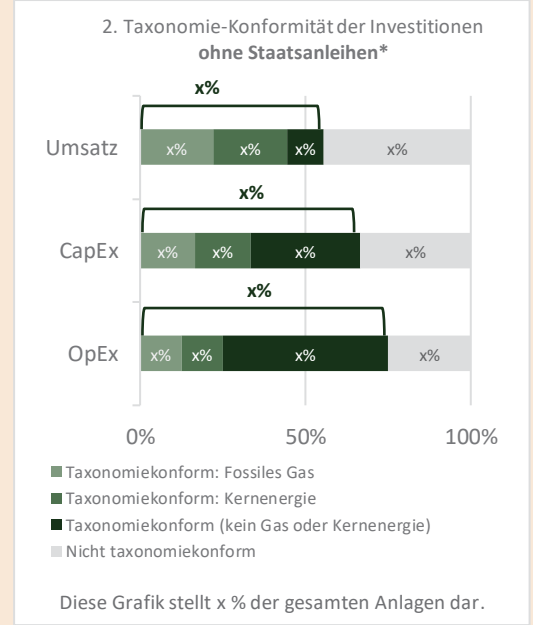
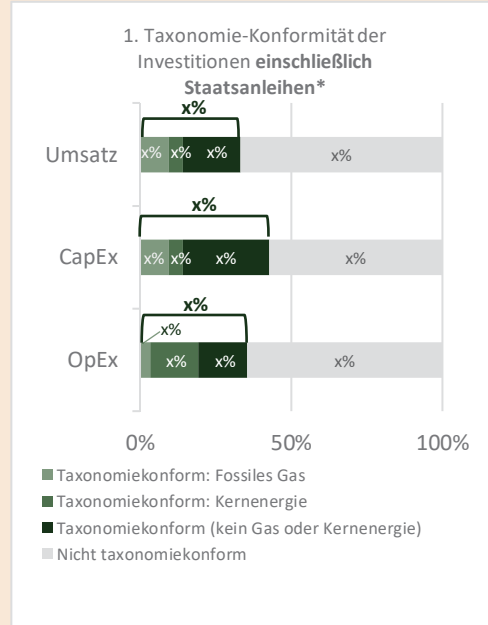
Nein

² Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Das Portfolio hielt 41,4 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, das nicht mit der EU-Taxonomie konform ist.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Das Portfolio hielt 18,7 % an sozial nachhaltigen Investitionen.



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 wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder zur Gewährleistung einer adäquaten Liquidität, Absicherung und Besicherung.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhindert und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das externe oder NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die Gesamtbetrachtung der Unternehmen bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Manager arbeitete mit den Unternehmen über ein solides ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung der Mitwirkung verfolgt.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Global Sustainable Value Fund (das „Portfolio“)*

Unternehmenskennung: 549300VLTCS1K4EA7H66

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Nein

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 66,9 %* an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

*Mit Wirkung vom 2. August 2023 änderte der Neuberger Berman Systematic Global Sustainable Value Fund seinen Namen in Neuberger Berman Global Sustainable Value Fund.

**Weitere Einzelheiten zur Vermögensallokation des Portfolios (einschließlich des Engagements in nachhaltigen Investitionen) finden Sie nachfolgend unter der Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“.

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „Bezugszeitraum“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben zudem die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung dieser ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.

In dem Bestreben, das Portfolio auf ein Netto-Null-Ziel auszurichten, bewarb und bewirbt der Sub-Investment-Manager künftig die Verringerung des CO₂-Fußabdrucks des Portfolios in Bezug auf Scope-1-, Scope-2- und wesentliche Scope-3-Treibhausgasemissionen.¹ Es existiert kein jährliches Reduktionsziel. Stattdessen wird sich auf das Zwischenziel 2030 und das Netto-Null-Ziel 2050 konzentriert.

- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzmitteln und zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Anreize für Mitarbeiter und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsnormen in der Lieferkette, Vielfalt und Integration der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortungsvolles Marketing.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem Composite-ESG-Rating gemessen und wird im Folgenden in aggregierter Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

I. Das Composite-ESG-Rating:

Die vorstehend aufgeführten ökologischen und sozialen Merkmale wurden anhand einer Mischung aus ökologischen und sozialen Merkmalen abgeleitet und beurteilt, die aus dem hausinternen Neuberger Berman ESG-Ratingsystem (der „**NB-ESG-Quotient**“) und einem themenbasierten ESG-Ratingsystem („**NB-ESG-Themen**“), (zusammen das „**Composite-ESG-Rating**“) stammen.

Der NB- ESG-Quotient basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und ergab ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem er diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet. Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („NB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentrierte, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen werden. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

¹Scope-1-Emissionen sind direkte Emissionen aus Quellen, die sich im Besitz des Unternehmens befinden oder von ihm kontrolliert werden (z. B. Emissionen, die sich direkt durch die Geschäftsprozesse des Unternehmens oder durch Fahrzeuge im Besitz des Unternehmens ergeben). Scope-2-Emissionen sind indirekte Emissionen aus der Erzeugung von Strom, Dampf, Wärme und Kälte, die vom Unternehmen verbraucht werden. Scope-3-Emissionen sind alle anderen indirekten Emissionen, die in der Wertschöpfungskette eines Unternehmens anfallen (u. a. Emissionen aus den vom Unternehmen verbrauchten Produkten oder Dienstleistungen, aus der Entsorgung seiner Abfälle, aus dem Pendelverkehr seiner Mitarbeiter, aus dem Vertrieb und Transport seiner Produkte oder aus seinen Investitionen).

Das Ratingsystem in Bezug auf NB-ESG-Themen basiert auf dem Konzept sektorspezifischer ESG-Themen (bereitgestellt von Drittanbietern), die individuell gewichtet wurden und ein unternehmensspezifisches Gesamtrating in Bezug auf NB-ESG-Themen ergaben. Die sektorspezifischen NB-ESG-Themen erstreckten sich auf einzelne wesentliche ESG-Belange bzw. -Merkmale oder aggregierten wesentliche ESG-Belange bzw. -Merkmale, die ihrerseits ein ESG-Thema bilden. Die betreffenden ökologischen und sozialen Merkmale sind vorstehend aufgeführt und Teil der übergeordneten ESG-Themen.

Unternehmen mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden Composite-ESG-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Unternehmen mit einem schlechten Composite-ESG-Rating, insbesondere dann, wenn ein Unternehmen diesbezüglich keine Maßnahmen ergriff, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Das Composite-ESG-Rating von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein Composite-ESG-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Bezugszeitraum | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|----------------------|--------|-----------|-----------------------|
| Composite-ESG-Rating | 0,6 | -1 bis +1 | 100 % |
| Daten von Dritten | 7,3 | 0-10 | |

Für das Composite-ESG-Rating wird ein Wert zwischen -1 und +1 verwendet, wobei -1 das niedrigste und +1 das höchste Rating darstellt.

Das durchschnittliche Composite-ESG-Rating ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

II. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy und, bis zum 2. August 2023, die Neuberger Berman Enhanced Sustainable Exclusions Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren). Zur Klarstellung sei angemerkt, dass die Neuberger Berman Enhanced Sustainable Exclusions Policy ab dem 2. August 2023 nicht mehr angewandt wurde. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischen Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem Composite-ESG-Rating und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. Composite-ESG-Rating

| | Composite-ESG-Rating | Rating der Daten durch externe Anbieter | Kombinierte Abdeckung |
|----------------------------|-----------------------------|--|------------------------------|
| Bereich | -1 bis +1 | 0-10 | 0-100 % |
| Bezugszeitraum 2022 | 0,6 | 7,3 | 100 % |
| Bezugszeitraum 2023 | 0,6 | 7,3 | 100 % |

Das Composite-ESG-Rating und die Bewertung der Daten Dritter sind im Vergleich zum Vorjahr unverändert geblieben.

2. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße.

| | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|--------------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0 |
| Bezugszeitraum 2023 | 0 |

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat, wie

nachstehend erläutert, und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Unternehmens, um festzustellen, ob das Unternehmen einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Unternehmens auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Sub-Investment-Manager überprüfte die Unternehmen auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Unternehmen dieser Prüfung standhielten, quantifizierte der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag der Unternehmen zur Wirtschaft.

Der Sub-Investment-Manager erfasste dies auf zwei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDGs“).

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbaren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Der Sub-Investment-Manager wandte seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigten. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „PAIs“):

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

| PAIs | |
|-----------------------------------|---|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgas-emissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind PAI 5 - Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren |
| <i>Biodiversität</i> | PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken |
| <i>Wasser</i> | PAI 8 - Emissionen in Wasser |
| <i>Abfall</i> | PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Sub-Investment-Manager hat auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche

Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die ILO-Grundsätze, die UNGC-Grundsätze und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „*Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?*“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.

2. Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| PAIs auf Produktebene | |
|-----------------------------------|--|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgas-emissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|------------------------|---|-------------------------|----------------|
| APPLE INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,1 % | USA |
| ALPHABET INC CLASS A | J – Information und Kommunikation | 1,7 % | USA |
| COMCAST CORP | J – Information und Kommunikation | 1,6 % | USA |
| MERCK & CO INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 1,5 % | USA |
| SHELL PLC | B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden | 1,5 % | Großbritannien |
| TOTALENERGIES | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 1,4 % | Frankreich |
| GILEAD SCIENCES INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 1,3 % | USA |
| ABBVIE INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 1,2 % | USA |
| MICROSOFT CORP | J – Information und Kommunikation | 1,2 % | USA |
| CISCO SYSTEMS INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 1,2 % | USA |
| AMERIPRISE FINANCE INC | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 1,1 % | USA |
| CIGNA | Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen | 1,1 % | USA |
| CITIGROUP INC | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 1,0 % | USA |
| APPLIED MATERIAL INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 1,0 % | USA |
| CSX CORP | H - Verkehr und Lagerung | 1,0 % | USA |



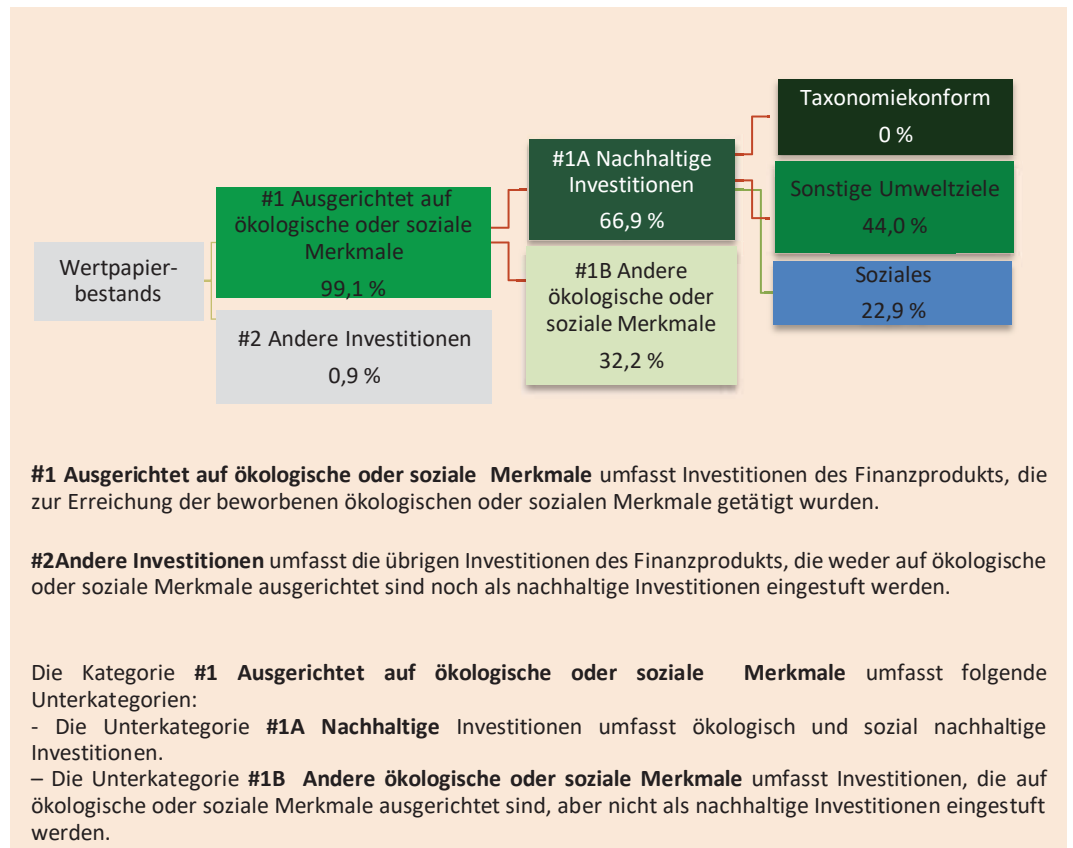
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 99,1 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio verpflichtet sich, mindestens 50 % an nachhaltigen Investitionen zu halten. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 66,9 % an nachhaltigen Investitionen.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 0,9 % an „sonstigen Investitionen“.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein ESG-Composite-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte, und seine Berechnungen können auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Dritten basieren. Die Berechnung beruhte auf einer Marktbewertung des Portfolios. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|--|-------------------------|
| B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden | 4,4 % |
| C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 38,8 % |
| D – Energieversorgung | 1,6 % |
| F – Baugewerbe/Bau | 2,9 % |
| G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 7,5 % |
| H - Verkehr und Lagerei | 4,0 % |
| I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie | 1,6 % |

| | |
|---|--------|
| J – Information und Kommunikation | 12,7 % |
| K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 20,7 % |
| L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 1,9 % |
| M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen | 0,8 % |
| N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 0,8 % |
| Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen | 2,0 % |
| S – Sonstige Dienstleistungen | 0,1 % |
| Keine | 0,1 % |



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine 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?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, ob das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert²?

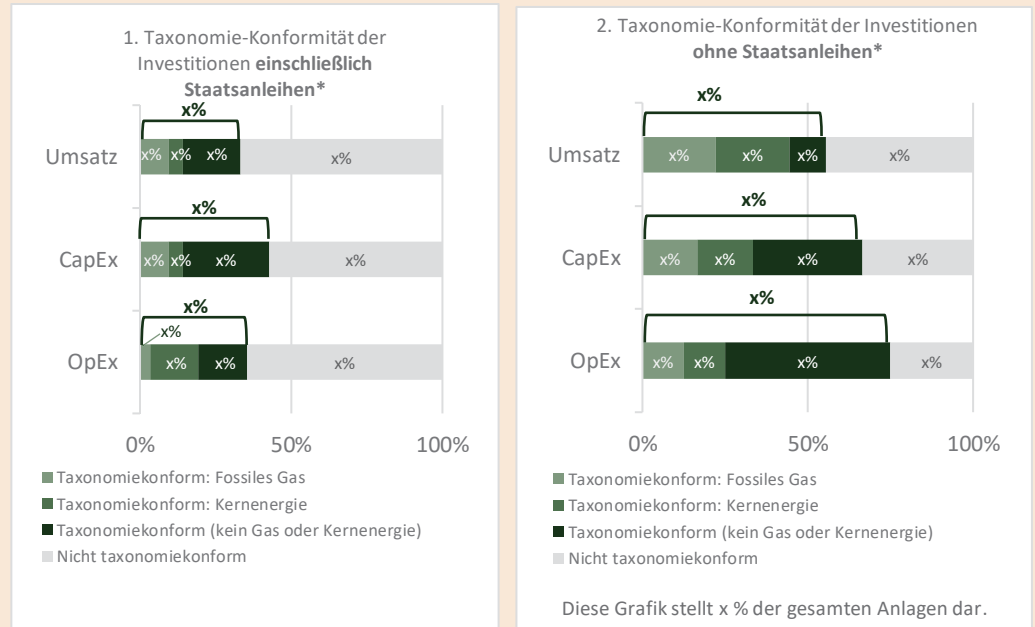
- Ja:
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

² Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Das Portfolio hielt 44,0 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Das Portfolio hielt 22,9 % an sozial nachhaltigen Investitionen.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) das Composite-ESG-Rating sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das ESG-Composite-Rating (wie vorstehend erläutert) wurde verwendet, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu messen. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (das ESG-Composite-Rating) in die Gesamtbetrachtung der Unternehmen bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager nutzte die von NB intern geführten Dialoge mit den Managementteams der Unternehmen. Dies wurde durch ein robustes ESG-Dialogprogramm erreicht, das auf Ebene der NB-Einheiten und nicht auf Portfolioebene stattfand. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen intern geführten Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung der Mitwirkung verfolgt.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

k.A.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

k.A.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

k.A.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman High Yield Bond Fund (das „Portfolio“)

Unternehmenskennung: 549300IJY8N43QRUU802

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| ● ● <input type="checkbox"/> Ja | ● ● <input checked="" type="checkbox"/> Nein |
|--|---|
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___% <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht 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 ___% an nachhaltigen Investitionen <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 |
| <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 |

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO₂-Fußabdrucks*, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, Recycling-Praktiken und -Trends, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen zur Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „NB- ESG-Quotient“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („NB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentrierte, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen werden. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen. Jedes Sektorkriterium wurde unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistentams für das Portfolio genutzt wurde.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergriffen hat, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Des Weiteren war der Sub-Investment-Manager bestrebt, eine konstruktive Zusammenarbeit mit den Unternehmensemittenten zu priorisieren.

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Bezugszeitraum | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | 57 | 1-100 | 99 % |
| Daten von Dritten | 5,3 | 0-10 | |

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmensemittenten gemessen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und Chancen durch den Klimawandel pro Emission und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit eine Emission durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 12,3 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten

beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 51 %, was aus dem Durchschnitt der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet wurde.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlage des Portfolios).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

| | NB-ESG-Quotient-Rating | Rating der Daten durch externe Anbieter | Kombinierte Abdeckung |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| Bereich | 1-100 | 0-10 | 0-100 % |
| Bezugszeitraum 2022 | 57 | 5,0 | 99 % |
| Bezugszeitraum 2023 | 57 | 5,3 | 99 % |

Im Vergleich zum Vorjahr ist die Bewertung des NB-ESG-Quotienten unverändert geblieben und die Bewertung der Daten Dritter hat sich verbessert. Dies ist unter Umständen auf eine Verbesserung bei den einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten gemäß externem Datenanbieter oder auf Differenzen im von dem Anbieter bereitgestellten externen Rating des Emittenten zurückzuführen.

2. CVaR

| | CVaR | Abdeckung |
|----------------------------|-------------|------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | -12,0 % | 57 % |
| Bezugszeitraum 2023 | -12,3 % | 51 % |

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die CVaR-Prognose aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmensemittenten und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verändert.

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die CVaR-Abdeckung aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmensemittenten und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verändert.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

| | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|--------------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0 |
| Bezugszeitraum 2023 | 0 |

● ***Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?***

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

k.A.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| PAIs auf Produktebene | |
|-----------------------------------|--|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgas-emissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|---|--|-------------------------|---------|
| NEW FORTRESS ENERGY INC 144A | D – Energieversorgung | 0,9 % | USA |
| AMERICAN AIRLINES INC 144A | H - Verkehr und Lagerung | 0,9 % | USA |
| AMERICAN AIRLINES INC 144A | H - Verkehr und Lagerung | 0,8 % | USA |
| TREASURY NOTE (OLD) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung | 0,7 % | USA |
| PAREXEL 2L TL-B 7/21 Prvt | Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen | 0,6 % | USA |
| ALLIANT HOLDINGS INTERMEDIATE LLC 144A | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 0,6 % | USA |
| TRANSDIGM INC 144A | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 0,6 % | USA |
| CCO HOLDINGS LLC 144A | J – Information und Kommunikation | 0,6 % | USA |
| BLACKSTONE COP HOLDCO LP 144A | N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 0,6 % | USA |
| PRESIDIO HOLDING INC 144A | J – Information und Kommunikation | 0,6 % | USA |
| CSC HOLDINGS LLC 144A | J – Information und Kommunikation | 0,5 % | USA |
| CHART INDUSTRIES INC 144A | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 0,5 % | USA |
| SUMMIT MIDSTREAM HOLDINGS LLC 144A | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 0,5 % | USA |
| GLOBAL INFRASTRUCTURE SOLUTIONS IN 144A | F – Baugewerbe/Bau | 0,5 % | USA |
| CARNIVAL HOLDINGS (BERMUDA) LTD 144A | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 0,5 % | Bermuda |

O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.



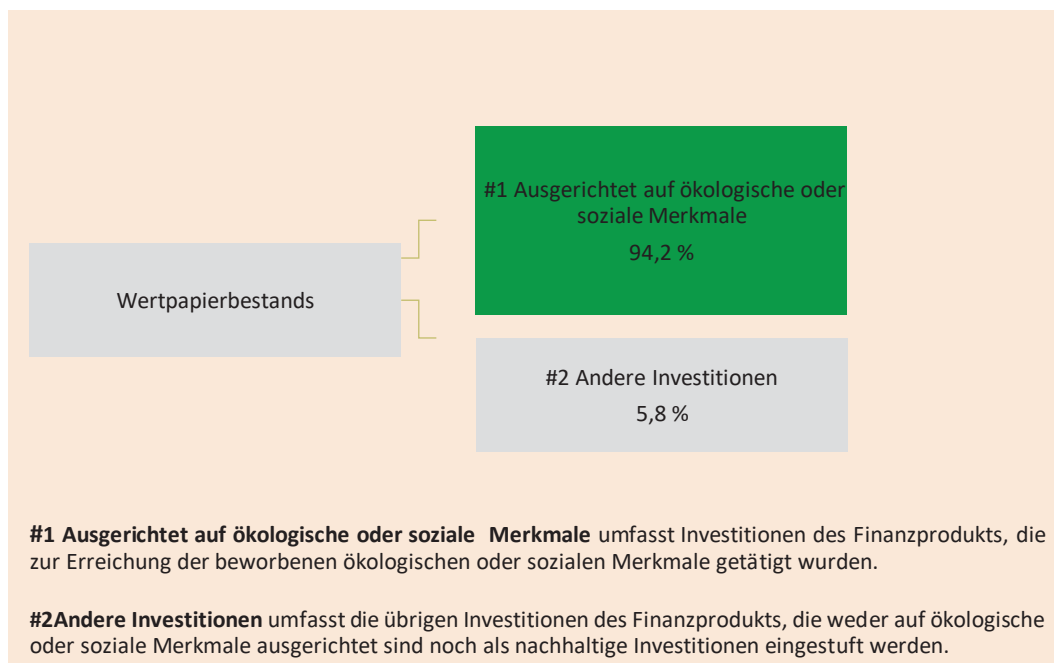
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 94,2 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 5,8 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Der Bezugszeitraum ist ein Durchschnitt der vier Kalenderquartalsenden.



In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Bildung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|--|--------------------------------|
| B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden | 8,1 % |
| C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 15,6 % |
| D – Energieversorgung | 4,9 % |
| E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen | 0,1 % |
| F – Baugewerbe/Bau | 1,6 % |
| G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 5,1 % |
| H - Verkehr und Lagerei | 10,9 % |
| I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie | 0,5 % |
| J – Information und Kommunikation | 12,8 % |
| K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 19,4 % |
| L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 3,9 % |
| M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen | 0,6 % |
| N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 7,0 % |
| O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung | 0,7 % |
| P – Erziehung und Unterricht | 0,0 % |
| Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen | 3,6 % |
| R – Kunst, Unterhaltung und Erholung | 2,3 % |
| S – Sonstige Dienstleistungen | 0,3 % |
| Keine | 2,5 % |

O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für

Kernenergie beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine 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?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

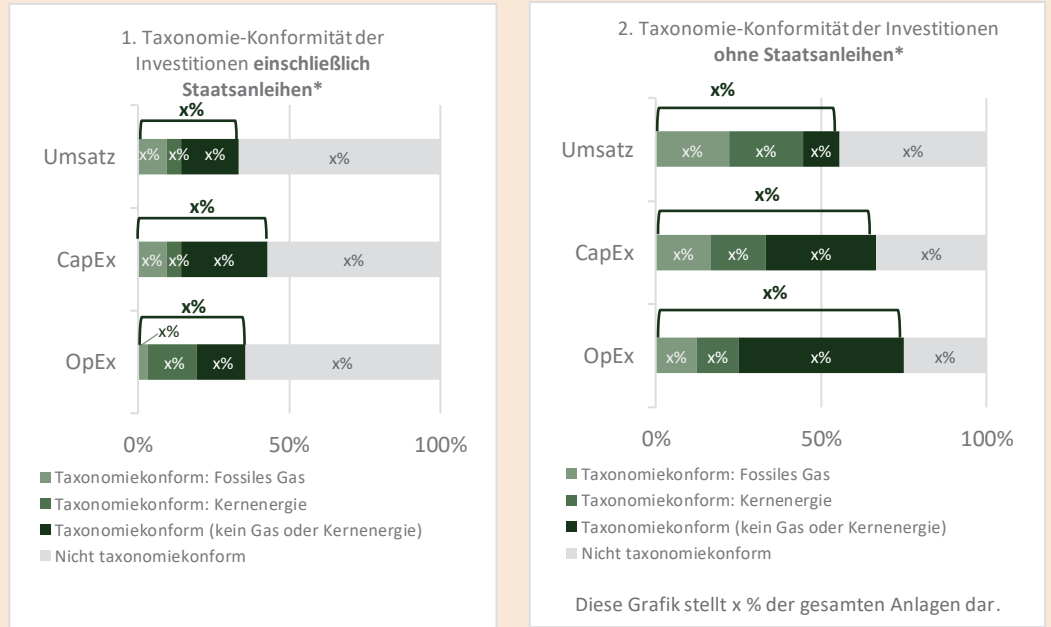
Nein

¹ Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager war der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittentenanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman InnovAsia 5G Fund (das „Portfolio“)

Unternehmenskennung: 549300VMISY5R7FEHX25

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Nein

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 27,4 %* an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

*Weitere Einzelheiten zur Vermögensallokation des Portfolios (einschließlich des Engagements in nachhaltige Investitionen) finden Sie unter der Frage „*Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?*“

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzmitteln und zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Anreize für Mitarbeiter und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsnormen in der Lieferkette, Vielfalt und Integration der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortungsvolles Marketing.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**NB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistenteam für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient- oder externes Rating aufwiesen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachten) zu erreichen.

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Bezugszeitraum | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|----------------|-------------------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | ES: C G:2.5 | ES: A-D G: 1-4 | 96 % |
| Daten von Dritten | 4,7 | 1-10 | |

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale („ES“) werden die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („G“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und der Chancen durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 8,0 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller

klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 89 %, was einem Durchschnitt des CVaR über die vier Kalenderquartalsenden hinweg entspricht.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy und die Neuberger Berman Enhanced Sustainable Exclusion Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischen Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstießen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörtere und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

| | NB-ESG-Quotient-Rating | Rating der Daten durch externe Anbieter | Kombinierte Abdeckung |
|----------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| Bereich | ES: A-D G: 1-4 | 0-10 | 0-100 % |

| | | | |
|----------------------------|-----------------|-----|------|
| Bezugszeitraum 2022 | ES: C G: 2,2 | 4,3 | 86 % |
| Bezugszeitraum 2023 | ES:C G: 2,5 | 4,7 | 96 % |

Das ES-Rating des NB-ESG-Quotienten ist im Vergleich zum Vorjahr unverändert geblieben, das G-Rating des NB-ESG-Quotienten hat sich verschlechtert und das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich verbessert. Dies ist unter Umständen auf Verbesserungen bei den einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmen gemäß externem Datenanbieter oder auf Differenzen des von dem Anbieter bereitgestellten externen Rating des Unternehmens zurückzuführen.

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die kombinierte Abdeckung durch den NB-ESG-Quotienten und das Rating externer Anbieter verbessert. Dies ist auf eine verbesserte Datenabdeckung bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmen und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

2. CVaR

| | CVaR | Abdeckung |
|----------------------------|-------------|------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | -5,3 % | 87 % |
| Bezugszeitraum 2023 | -8,0 % | 89 % |

Die CVaR-Prognose hat sich im Vergleich zum Vorjahr aufgrund einer verbesserten Datenabdeckung bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmen und der Handelsaktivitäten im Portfolio verändert. Wie bereits erwähnt, kann die Szenarioanalyse als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken dienen, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

3. Ausschlüsse

| | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|--------------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0 |
| Bezugszeitraum 2023 | 0 |

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat, wie nachstehend erläutert, und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf

die gute Unternehmensführung eines Unternehmens, um festzustellen, ob das Unternehmen einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Unternehmens auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Sub-Investment-Manager überprüfte die Unternehmen auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Unternehmen dieser Prüfung standhielten, quantifizierte der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag der Unternehmen zur Wirtschaft.

Der Sub-Investment-Manager erfasste dies auf zwei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDGs“).

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbaren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Der Sub-Investment-Manager wandte seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigten. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „PAIs“):

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

| PAIs | |
|-------------------------------|--|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgasemissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind PAI 5 - Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren |
| <i>Biodiversität</i> | PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken |
| <i>Wasser</i> | PAI 8 - Emissionen in Wasser |

| | |
|-----------------------------------|--|
| <i>Abfall</i> | PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | <p>PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen</p> <p>PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen</p> <p>PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle</p> <p>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen</p> <p>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)</p> |

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Sub-Investment-Manager hat auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „*Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?*“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.

2. Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „PAIs auf Produktebene“):

| PAIs auf Produktebene | |
|-----------------------------------|--|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgas-emissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|------------------------------------|--|-------------------------|-------------------------|
| SK HYNIX INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 4,0 % | Republik Korea |
| HARMONIC DRIVE SYSTEMS INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 3,7 % | Japan |
| FABRINET | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 3,6 % | Thailand |
| JENTECH PRECISION INDUSTRIAL LTD | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 3,6 % | Taiwan (Republik China) |
| ACCTON TECHNOLOGY CORP | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 3,0 % | Taiwan (Republik China) |
| AEM HOLDINGS LTD | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,9 % | Singapur |
| EMEMORY TECHNOLOGY INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,8 % | Taiwan (Republik China) |
| SMC (JAPAN) CORP | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,8 % | Japan |
| JMDC INC | J – Information und Kommunikation | 2,7 % | Japan |
| SANSAN INC | J – Information und Kommunikation | 2,5 % | Japan |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,5 % | Taiwan (Republik China) |
| MERCARI INC | G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 2,4 % | Japan |
| ROHM LTD | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,4 % | Japan |
| E INK HOLDINGS INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,3 % | Taiwan (Republik China) |
| FPT CORP | J – Information und Kommunikation | 2,3 % | Vietnam |



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

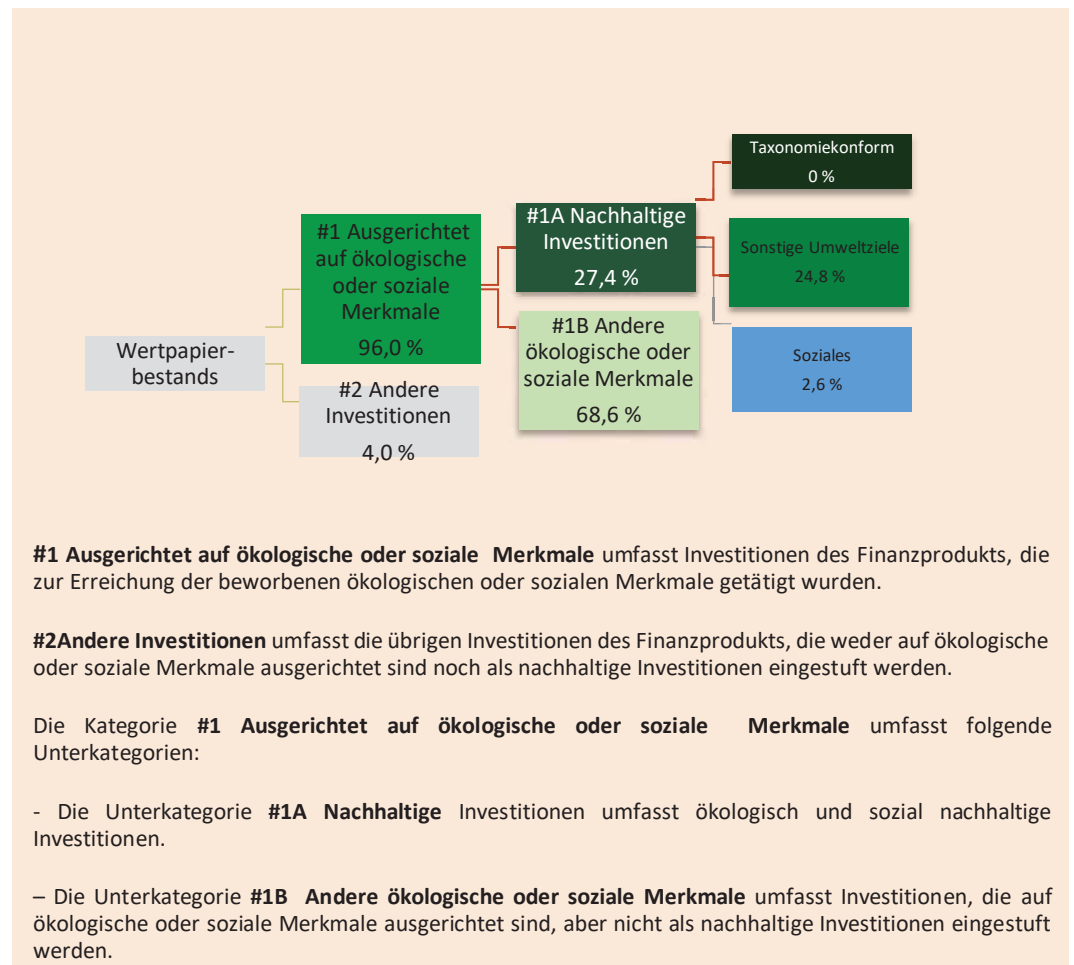
Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 96,0 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio verpflichtet sich, mindestens 10 % an nachhaltigen Investitionen zu halten. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 27,4 % an nachhaltigen Investitionen.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und

keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 4,0 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|--|-------------------------|
| C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 69,5 % |
| G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 3,5 % |

| | |
|---|--------|
| J – Information und Kommunikation | 18,7 % |
| K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 1,3 % |
| M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen | 2,4 % |
| N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 1,5 % |
| P – Erziehung und Unterricht | 1,7 % |
| Keine | 1,3 % |



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine 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?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

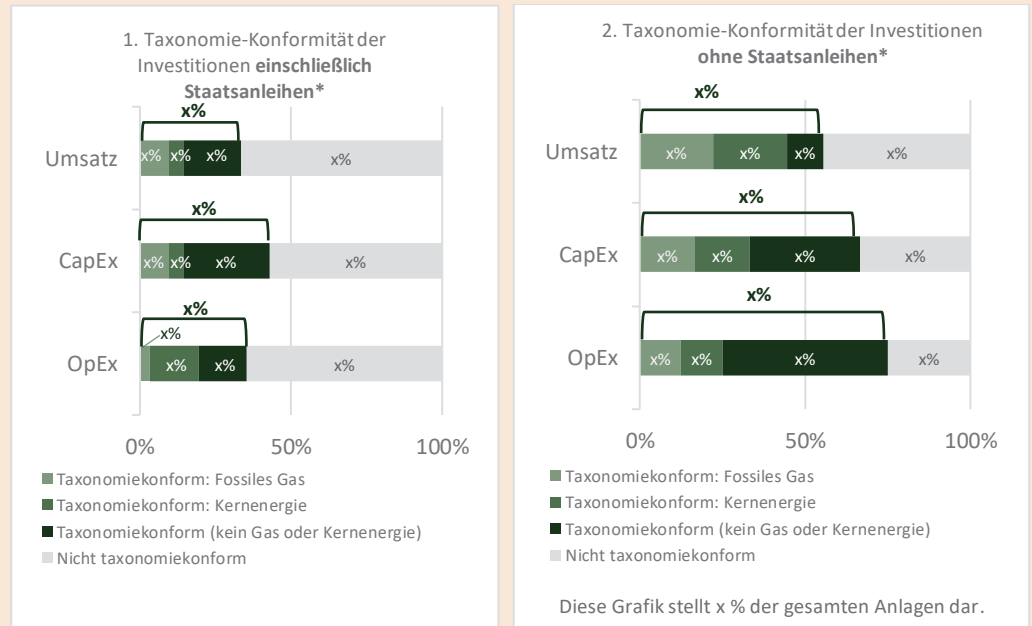
- Ja:
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

¹ Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Das Portfolio hielt 24,8 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden.



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?

Das Portfolio hielt 2,6 % an sozial nachhaltigen Investitionen.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das externe oder NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung eines Unternehmens besser zu erkennen, wobei darauf hingewiesen wird, dass der Schwerpunkt des Portfolios auf Investitionen in Unternehmen liegt, welche die Entwicklung des Themas „Innovative Technologies“ fördern.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die thematische Beurteilung und die Gesamtbeurteilung des Unternehmens bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Japan Equity Engagement Fund (das „Portfolio“)

Unternehmenskennung: 549300ELGQMFUUPHG878

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Nein

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Alle Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnitt der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben zudem die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung dieser ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („**THG**“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzmitteln und zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Anreize für Mitarbeiter und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsnormen in der Lieferkette, Vielfalt und Integration der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortungsvolles Marketing.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit der hausinternen NB-ESG-Bewertung gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Die hausinterne NB-ESG-Bewertung:

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte als Teil des Anlageprozesses verschiedene ökologische und soziale Merkmale für sein Bewertungsmodell. Der Sub-Investment-Manager griff auf eine hausinterne ESG-Bewertung von Neuberger Berman („**NB**“) zurück, der an den japanischen Markt angepasst wurde. Die hausinterne NB-ESG-Bewertung berücksichtigte in ihrem Bewertungsmodell außerdem das Mitwirkungspotenzial. Ferner berücksichtigte die hausinterne NB-ESG-Bewertung die von der Wesentlichkeitsmatrix von NB identifizierten ökologischen und sozialen Merkmale, die auf dem Wesentlichkeitsrahmen des Sustainability Accounting Standards Board („**SASB**“) basieren. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB konzentrierte sich auf die ESG-Merkmale, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden.

Grundlage für die hausinterne NB-ESG-Bewertung von NB ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von NB. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB konzentrierte sich auf die ESG-Merkmale, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sekorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteten ESG-Daten erstellt. Ergänzend kommen interne qualitative Analysen hinzu, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams des Sub-Investment-Managers genutzt wird.

Die hausinterne NB-ESG-Bewertung gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren für jeden Sektor, um davon eine hausinterne NB-ESG-Bewertung für Unternehmen abzuleiten, die im Portfolio gehalten werden. Unternehmen mit einer günstigen und/oder sich verbessernden hausinternen NB-ESG-Bewertung erhalten eine höhere Punktzahl, was bei der Erhöhung der Gewichtung der Unternehmen im Portfolio ein wesentlicher Gesichtspunkt war. Unternehmen mit einer schlechten hausinternen NB-ESG-Bewertung, insbesondere dann, wenn ein Unternehmen keine diesbezüglichen Maßnahmen ergriff, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit mit einer niedrigeren Bewertung versehen, wodurch die Gewichtung eines Unternehmens im Portfolio verringert werden konnte. Darüber hinaus bemühte sich der Sub-Investment-Manager, konstruktiven Dialogen bei im Portfolio gehaltenen Unternehmen Vorrang einzuräumen, um deren Bemühungen bei der Bewältigung wesentlicher Belange zu unterstützen, die der Sub-Investment-Manager für die unternehmerischen Fundamentaldaten und das langfristige Wachstum des Unternehmens, einschließlich ökologischer und sozialer Belange als ausschlaggebend erachtete. Der Erfolg der konstruktiven Mitwirkungsbemühungen des Sub-Investment-Managers gegenüber den Emittenten hängt davon ab, wie offen die Emittenten sind und wie sie auf eine solche Mitwirkung reagieren.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

| Bezugszeitraum | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|--------------------------|-------------------|--------------------|-----------------------|
| Interne NB-ESG-Bewertung | ES: 7,7 G: 7,7 | ES: 1-15 G:1-15 | 98 % |
| Daten von Dritten | 5,5 | 0-10 | |

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Im Hinblick auf die hausinterne NB-ESG-Bewertung wurde ein separates Rating zwischen 1 und 15 für ökologische und soziale Merkmale („**ES**“) sowie zur Bewertung der Governance („**G**“) verwendet, wobei 15 dem höchsten und 1 dem niedrigsten Rating entspricht. Für dieses Portfolio gibt es keine hausinterne NB-ESG-Mindestbewertung, die ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Die durchschnittliche hausinterne NB-ESG-Bewertung ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und der Chancen durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 21,8 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet. Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als

Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 77 %. Diese Deckung ist ein Durchschnitt der CVaR-Abdeckung über die vier Kalenderquartalsenden hinweg.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy und die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus der hausinternen NB-ESG-Bewertung und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. Interne NB-ESG-Bewertung

| | Interne NB-ESG-Bewertung | Rating der Daten durch externe Anbieter | Kombinierte Abdeckung |
|----------------|---------------------------------|--|------------------------------|
| Bereich | ES:1-15 G: 1-15 | 0-10 | 0-100 % |

| | | | |
|----------------------------|-------------------|-----|-------|
| Bezugszeitraum 2022 | ES: 8,1 G: 8,5 | 5,1 | 100 % |
| Bezugszeitraum 2023 | ES: 7,7 G: 7,7 | 5,5 | 98 % |

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die hausinterne NB-ESG-Bewertung verschlechtert, und die Bewertung der Daten Dritter hat sich verbessert. Dies ist unter Umständen auf Verbesserungen bei den einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmen gemäß externem Datenanbieter oder auf Differenzen des von dem Anbieter bereitgestellten externen Rating des Unternehmens zurückzuführen.

2. CVaR

| | CVaR | Abdeckung |
|----------------------------|-------------|------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | -20,7 % | 90 % |
| Bezugszeitraum 2023 | -21,8 % | 77 % |

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die CVaR-Prognose aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmen und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verändert.

Die CVaR-Abdeckung des Portfolios ist im Vergleich zum Vorjahr zurückgegangen. Zurückzuführen ist dies auf die Handelsaktivität und Datenbeschränkungen. Der CVaR wird nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und ist stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die es ausreichende und zuverlässige Daten gibt.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße.

| | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|--------------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0 |
| Bezugszeitraum 2023 | 0 |

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

k.A.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten. Dessen ungeachtet war der Sub-Investment-Manager nicht in Unternehmen investiert, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| PAIs auf Produktebene | |
|-----------------------------------|--|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgasemissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| <i>Soziales Beschäftigung</i> und | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts** entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|-----------------------------|--|-------------------------|-------|
| OKINAWA CELLULAR TELEPHONE | J – Information und Kommunikation | 5,0 % | Japan |
| FP PARTNER INC | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 4,3 % | Japan |
| TOKYU FUDOSAN HOLDINGS CORP | F – Baugewerbe/Bau | 3,8 % | Japan |
| AMADA LTD | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 3,7 % | Japan |
| DAIWA INDUSTRIES LTD | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 3,5 % | Japan |
| JSB LTD | L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 3,4 % | Japan |
| RICOH LTD | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 3,3 % | Japan |
| SHOEI LTD | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 3,2 % | Japan |
| USS LTD | G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 3,0 % | Japan |
| OPEN UP GROUP INC | N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 2,9 % | Japan |
| OSAKA SODA LTD | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,6 % | Japan |
| NIFCO INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,5 % | Japan |
| PILOT CORP | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,5 % | Japan |
| YAMANASHI CHUO BANK LTD | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 2,2 % | Japan |
| TRANSACTION LTD | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,1 % | Japan |



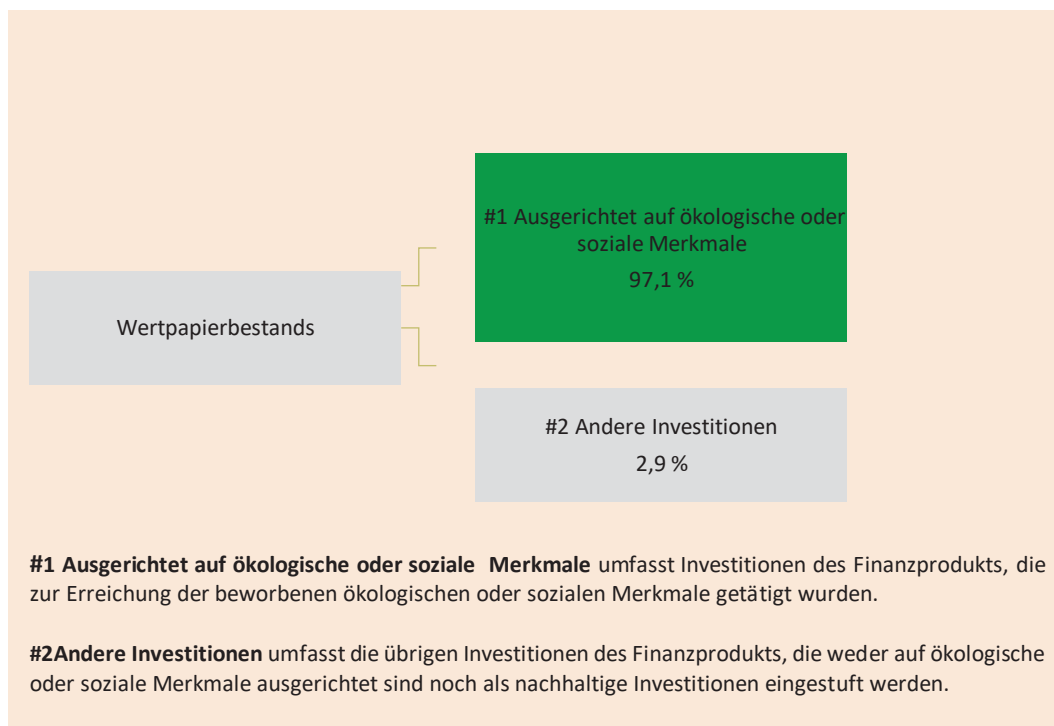
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 97,1 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 2,9 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder eine hausinterne NB-ESG-Bewertung oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|--|-------------------------|
| C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 43,6 % |
| E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen | 2,1 % |
| F – Baugewerbe/Bau | 4,5 % |
| G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 7,0 % |
| H – Verkehr und Lagerei | 2,3 % |
| I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie | 1,6 % |
| J – Information und Kommunikation | 14,8 % |
| K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 12,4 % |
| L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 4,4 % |
| M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Tätigkeiten | 0,4 % |
| N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 4,7 % |
| Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen | 0,7 % |
| R – Kunst, Unterhaltung und Erholung | 0,7 % |

Keine

0,8 %



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

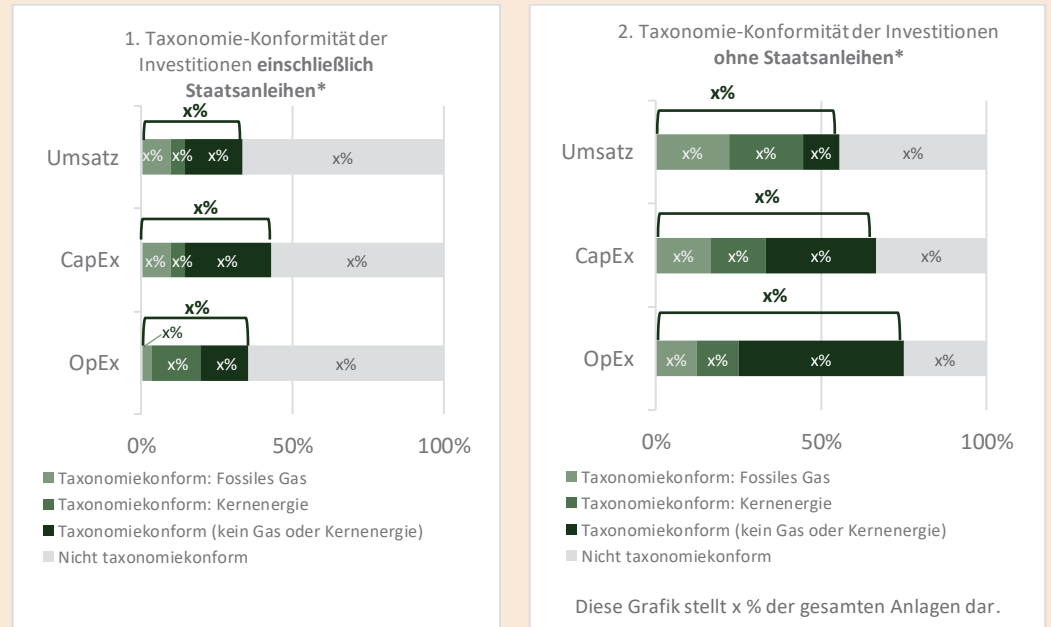
Nein

¹ Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) die hausinterne NB-ESG-Bewertung sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Für Belange der ökologischen und sozialen Verantwortlichkeit verfolgte der Sub-Investment-Manager über die hausinterne NB-ESG-Bewertung einen Top-down-Ansatz. Die hausinterne NB-ESG-Bewertung nutzte die Wesentlichkeitsmatrix von NB, um diejenigen Nachhaltigkeitsfaktoren zu identifizieren, die eine wesentliche Auswirkung auf die Nachhaltigkeit des Unternehmens gehabt haben könnten. Anschließend analysierte der Sub-Investment-Manager diese Belange im Hinblick auf das Geschäftsmodell, die Wertschöpfungskette, die Wachstumsphase des jeweiligen Unternehmens und dessen Wettbewerbsposition, um vorrangige Probleme zu identifizieren, die umgehend angegangen werden mussten. Dies geschah anhand von Recherchen vor Ort, bei der über mehrere Jahre öffentlich zugängliche Unternehmensinformationen durchforstet wurden, sowie Gesprächen mit dem Unternehmen, Konkurrenten, Lieferanten, Kunden und externen Researchanbietern, sofern durchführbar.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses.

Sobald das Portfolio in ein Unternehmen investiert hat, setzt der Sub-Investment-Manager ein Mitwirkungsziel und eine individuelle Strategie fest, um die im Rahmen des Bewertungsprozesses identifizierten wesentlichen Belange finanzieller Art anzugehen. Die Zusammenarbeit des Sub-Investment-Managers mit Portfoliobeständen zielte darauf ab, diesen Unternehmen zu helfen, ein langfristiges Wachstum zu generieren. Als langfristiger Anleger mit Fokus auf die Bottom-up-Aktienauswahl war der Sub-Investment-Manager der Ansicht, dass er mittels eines tiefgreifenden Dialogs über das Kapitalmanagement, Umwelt- und Sozialthemen von finanzieller Wesentlichkeit sowie die Corporate Governance das jeweilige Unternehmen dabei unterstützte, ein langfristiges Wachstumsprofil aufrechtzuerhalten, was letztlich einen Performancebeitrag für das Portfolio leistete. Die Erfahrung des Sub-Investment-Managers bei der Zusammenarbeit mit Unternehmen zeigt, dass kleinere Unternehmen mehr Zeit und Ressourcen zur Bewältigung dieser Themen in Anspruch nehmen (im Durchschnitt zwei bis drei Jahre für Umwelt- und Sozialthemen). In Anbetracht dieses relativ langwierigen Prozesses führte der Sub-Investment-Manager ein System der Meilensteine ein, um sicherzustellen, dass die Mitwirkung weiterhin das gewünschte Ziel erbringt.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
k.A.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Next Generation Mobility Fund (das „Portfolio“)

Unternehmenskennung: 5493000YD3J3W1CMMU74

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 47,5 %* an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

*Weitere Einzelheiten zur Vermögensallokation des Portfolios (einschließlich des Engagements in nachhaltigen Investitionen) finden Sie unter der Frage „*Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?*“.

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („**THG**“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzmitteln und zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Anreize für Mitarbeiter und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsnormen in der Lieferkette, Vielfalt und Integration der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortungsvolles Marketing.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Investitionen) im Sinne der EU-Taxonomie

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**NB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistenteam für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient- oder externes Rating aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachen) zu erreichen.

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

| Bezugszeitraum | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|---|-----------------|-------------------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | ES: B G: 2,3 | ES: A-D G: 1-4 | 93 % |
| Rating der Daten durch externe Anbieter | 7,1 | 0-10 | |

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale („ES“) werden die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („G“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („CVaR“) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und der Chancen durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 5,0 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 92 %, was einem Durchschnitt der CVaR-Abdeckung über die vier Kalenderquartalsenden hinweg entspricht.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy und die Neuberger Berman Enhanced Sustainable Exclusion Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

| | NB-ESG-Quotient-Rating | Rating der Daten durch externe Anbieter | Kombinierte Abdeckung |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| Bereich | ES: A-D G:1- 4 | 0-10 | 0-100 % |
| Bezugszeitraum 2022 | ES: B G: 2,2 | 6,7 | 99 % |
| Bezugszeitraum 2023 | ES: B G:2.3 | 7,1 | 93 % |

Das ES-Rating des NB-ESG-Quotienten ist im Vergleich zum Vorjahr unverändert geblieben, das G-Rating des NB-ESG-Quotienten hat sich verschlechtert und das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich verbessert. Dies ist unter Umständen auf Verbesserungen bei den einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmen gemäß externem Datenanbieter oder auf Differenzen des von dem Anbieter bereitgestellten externen Rating des Unternehmens zurückzuführen.

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die kombinierte Abdeckung des NB-ESG-Quotienten und des externen Ratings aufgrund von Veränderungen bei den gehaltenen Unternehmen und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verlagert.

2. CVaR

| | CVaR | Abdeckung |
|----------------------------|--------|-----------|
| Bezugszeitraum 2022 | -3,6 % | 93 % |
| Bezugszeitraum 2023 | -5,0 % | 92 % |

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die CVaR-Prognose aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmen und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verändert.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

| | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|-------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0 |
| Bezugszeitraum 2023 | 0 |

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat, wie nachstehend erläutert, und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Unternehmens, um festzustellen, ob das Unternehmen einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Unternehmens auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Sub-Investment-Manager überprüfte die Unternehmen auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Unternehmen dieser Prüfung standhielten, quantifizierte der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag der Unternehmen zur Wirtschaft.

Der Sub-Investment-Manager erfasste dies auf zwei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDGs“).

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbaren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Der Sub-Investment-Manager wandte seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigten. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „PAIs“):

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

| PAIs | |
|-----------------------------------|--|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgasemissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind PAI 5 - Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren |
| <i>Biodiversität</i> | PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken |
| <i>Wasser</i> | PAI 8 - Emissionen in Wasser |
| <i>Abfall</i> | PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen |

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Sub-Investment-Manager hat auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

— — — *Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

— — — *Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:*

Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

- i. Wie oben unter „*Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?*“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.
- ii. Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| PAIs auf Produktebene | |
|--------------------------------|---|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgas-emissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |

| | |
|-----------------------------------|---|
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | <p>PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen</p> <p>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen</p> <p>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)</p> |
|-----------------------------------|---|

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|----------------------------|--|-------------------------|------|
| AMPHENOL CORP CLASS A | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 3,8 % | USA |
| ANSYS INC | J – Information und Kommunikation | 3,4 % | USA |
| ANALOG DEVICES INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 3,1 % | USA |
| LINDE PLC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 3,0 % | USA |
| CADENCE DESIGN SYSTEMS INC | J – Information und Kommunikation | 3,0 % | USA |
| NVIDIA CORP | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 3,0 % | USA |
| TRIMBLE INC | J – Information und Kommunikation | 2,8 % | USA |

| | | | |
|----------------------------------|--|-------|-------------|
| TE CONNECTIVITY LTD | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,8 % | USA |
| CATERPILLAR INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,7 % | USA |
| SCHNEIDER ELECTRIC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,6 % | USA |
| ASML HOLDING ADR REPRESENTING NV | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,6 % | Niederlande |
| MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,4 % | USA |
| APPLIED MATERIAL INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,4 % | USA |
| T MOBILE US INC | J – Information und Kommunikation | 2,3 % | USA |
| LATTICE SEMICONDUCTOR CORP | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,2 % | USA |



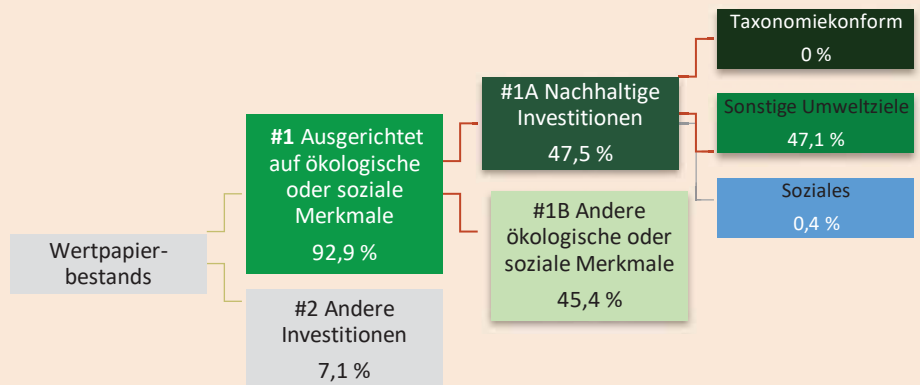
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 92,9 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio verpflichtet sich, mindestens 10 % an nachhaltigen Investitionen zu halten. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 47,5 % an nachhaltigen Investitionen.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 7,1 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige** Investitionen umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|---|-------------------------|
| B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden | 2,5 % |
| C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 72,8 % |
| G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 2,5 % |
| J – Information und Kommunikation | 19,8 % |
| K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 0,8 % |
| L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 1,0 % |
| M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen | 0,5 % |



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine 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?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

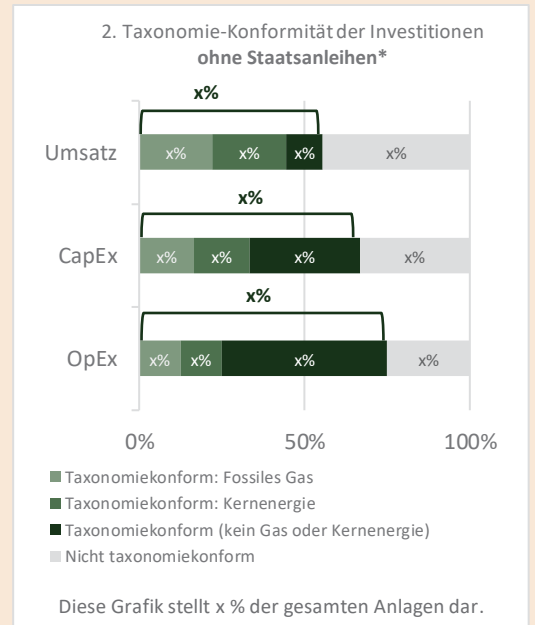
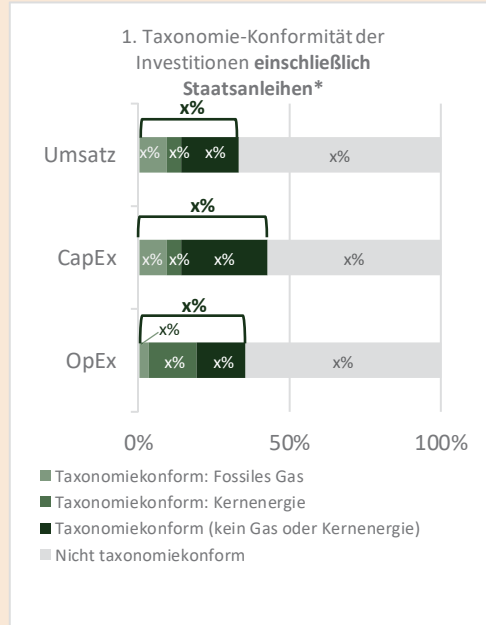
- Ja:
 In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

¹ Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Das Portfolio hielt 47,1 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, das nicht mit der EU-Taxonomie konform ist.



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?

Das Portfolio hielt 0,4 % an sozial nachhaltigen Investitionen.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

ESG-Merkmale werden auf drei verschiedenen Ebenen berücksichtigt:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das externe oder NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung eines Unternehmens besser zu erkennen, wobei darauf hingewiesen wird, dass der Schwerpunkt des Portfolios auf Investitionen in Unternehmen liegt, welche die Entwicklung des Themas „Next Generation Mobility“ fördern.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die thematische Beurteilung und die Gesamtbeurteilung des Unternehmens bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Next Generation Space Economy Fund (das „Portfolio“)
Unternehmenskennung: 549300FT24ZYHNJCVO63

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| <input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input type="checkbox"/> Ja | <input type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Nein |
|---|---|
| <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___% in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%</p> | <p><input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 31,0 %* an nachhaltigen Investitionen</p> <p><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</p> <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt</p> |

*Weitere Einzelheiten zur Vermögensallokation des Portfolios (einschließlich des Engagements in nachhaltige Investitionen) finden Sie unter der Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „Bezugszeitraum“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („**THG**“)*, Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.

*In dem Bestreben, das Portfolio auf ein Netto-Null-Ziel auszurichten, bewirbt der Sub-Investment-Manager die Verringerung des CO₂-Fußabdrucks des Portfolios in Bezug auf Scope-1-, Scope-2- und wesentliche Scope-3-Treibhausgasemissionen.¹ Es existiert kein jährliches Reduktionsziel. Stattdessen wird sich auf das Zwischenziel 2030 und das Netto-Null-Ziel 2050 konzentriert.

- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzmitteln und zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Anreize für Mitarbeiter und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsnormen in der Lieferkette, Vielfalt und Integration der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortungsvolles Marketing.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und werden im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**NB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektoorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistentams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB

¹Scope-1-Emissionen sind direkte Emissionen aus Quellen, die sich im Besitz des Unternehmens befinden oder von ihm kontrolliert werden (z. B. Emissionen, die sich direkt durch die Geschäftsprozesse des Unternehmens oder durch Fahrzeuge im Besitz des Unternehmens ergeben). Scope-2-Emissionen sind indirekte Emissionen aus der Erzeugung von Strom, Dampf, Wärme und Kälte, die vom Unternehmen verbraucht werden. Scope-3-Emissionen sind alle anderen indirekten Emissionen, die in der Wertschöpfungskette eines Unternehmens anfallen (u. a. Emissionen aus den vom Unternehmen verbrauchten Produkten oder Dienstleistungen, aus der Entsorgung seiner Abfälle, aus dem Pendelverkehr seiner Mitarbeiter, aus dem Vertrieb und Transport seiner Produkte oder aus seinen Investitionen).

ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient- oder externes Rating aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachten) zu erreichen.

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Bezugszeitraum | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|-----------------|-------------------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | ES: B G: 2,6 | ES: A-D G: 1-4 | |
| Daten von Dritten | 6,5 | 0-10 | 95 % |

Im Hinblick auf die NB-ESG-Quotient-Ratings der Aktienemittenten werden für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale (ES) die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („G“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und der Chancen durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten

auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 7,1 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 94 %, was einem Durchschnitt der CVaR-Abdeckung über die vier Kalenderquartalsenden hinweg entspricht.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy und die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren). Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht mehr in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige

Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

| | NB-ESG-Quotient-Rating | Rating der Daten durch externe Anbieter | Kombinierte Abdeckung |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| Bereich | ES: A-D G: 1-4 | 0-10 | 0-100 % |
| Bezugszeitraum 2022 | ES: B G: 2,7 | 6,2 | 97 % |
| Bezugszeitraum 2023 | ES: B G: 2,6 | 6,5 | 95 % |

Das ES-Rating des NB-ESG-Quotienten ist im Vergleich zum Vorjahr unverändert geblieben.

Die Bewertung G-Ratings des NB-ESG-Quotienten hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmen und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

Das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmen und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen sowie auf potenzielle Änderungen oder Unterschiede im externen Rating der Unternehmen.

2. CVaR

| | CVaR | Abdeckung |
|----------------------------|-------------|------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | -4,0 % | 82 % |
| Bezugszeitraum 2023 | -7,1 % | 94 % |

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die CVaR-Prognose aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmen und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verändert.

Die CVaR-Abdeckung des Portfolios hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf eine verbesserte Datenabdeckung bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmen und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

3. Ausschlüsse

| | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|--------------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0 |
| Bezugszeitraum 2023 | 0 |

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat, wie nachstehend erläutert, und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Unternehmens, um festzustellen, ob das Unternehmen einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Unternehmens auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Sub-Investment-Manager überprüfte die Unternehmen auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Unternehmen dieser Prüfung standhielten, quantifizierte der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag der Unternehmen zur Wirtschaft.

Der Sub-Investment-Manager erfasste dies auf zwei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDGs“).

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbaren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Der Sub-Investment-Manager wandte seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigten. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „PAIs“):

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

| PAIs | |
|-----------------------------------|---|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgas-emissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind PAI 5 - Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren |
| <i>Biodiversität</i> | PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken |
| <i>Wasser</i> | PAI 8 - Emissionen in Wasser |
| <i>Abfall</i> | PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Sub-Investment-Manager hat auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

— — —
Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

— — —
Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „*Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?*“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.
2. Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| PAIs auf Produktebene | |
|-----------------------------------|--|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgas-emissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene hing von der Verfügbarkeit angemessener, zuverlässiger und überprüfbarer Daten für diese Indikatoren ab. Stehen solche Daten nicht zur Verfügung, werden die PAIs auf Produktebene erst dann berücksichtigt, wenn diese Daten verfügbar sind. Der Sub-Investment-Manager wird die Liste der von ihm berücksichtigten PAIs auf Produktebene einer aktiven Überprüfung unterziehen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|------------------------------------|--|-------------------------|----------------|
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 4,4 % | USA |
| INTELLIAN TECHNOLOGIES INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 3,5 % | Republik Korea |
| ROCKET LAB USA INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 3,3 % | USA |
| SAFRAN SA | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 3,1 % | Frankreich |
| QUALCOMM INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 3,0 % | USA |
| SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 3,0 % | Singapur |
| AIRBUS | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,9 % | Frankreich |
| TRANSDIGM GROUP INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,7 % | USA |
| TRIMBLE INC | J – Information und Kommunikation | 2,7 % | USA |
| NVIDIA CORP | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,6 % | USA |
| ADVANCED MICRO DEVICES INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,6 % | USA |
| BOEING | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,5 % | USA |
| DEERE & CO | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,5 % | USA |
| AMAZON COM INC | G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 2,3 % | USA |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,3 % | USA |

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

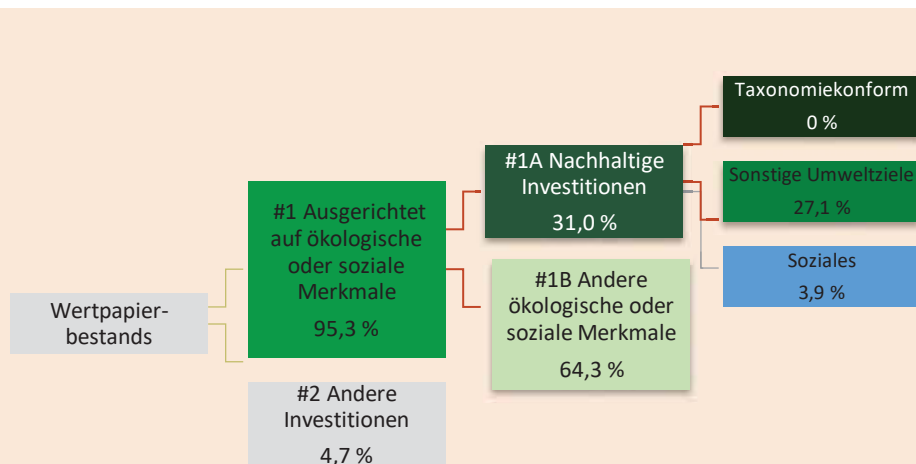
Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 95,3 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio verpflichtete sich, mindestens 10 % nachhaltige Investitionen zu halten. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 31,0 % an nachhaltigen Investitionen.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 4,7 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige** Investitionen umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.

- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|---|-------------------------|
| C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 68,0 % |
| G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 2,4 % |
| J – Information und Kommunikation | 24,3 % |
| K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 1,7 % |
| M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen | 3,5 % |



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert²?

- Ja:
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

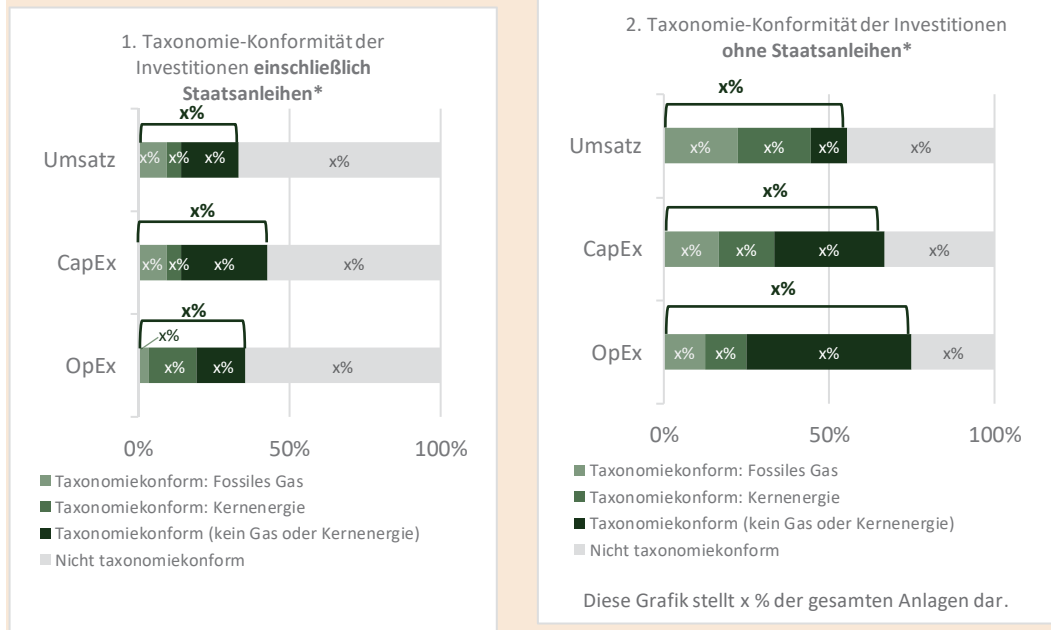
² Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Das Portfolio hielt 27,1 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, das nicht mit der EU-Taxonomie konform ist.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Das Portfolio hielt 3,9 % an sozial nachhaltigen Investitionen.

☞ 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 wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das externe oder NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung eines Unternehmens besser zu erkennen, wobei darauf hingewiesen wird, dass der Schwerpunkt des Portfolios auf Investitionen in Unternehmen liegt, welche die Entwicklung des Themas „Next Generation Space Economy“ fördern.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die thematische Beurteilung und die Gesamtbeurteilung des Unternehmens bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

k.A.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

k.A.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

k.A.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

k.A.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Responsible Asian Debt – Hard Currency Fund (das „Portfolio“)

Unternehmenskennung: 54930058PUF4SZOVOD17

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 48,0 %** an nachhaltigen Investitionen***

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

*Mit Wirkung vom 2. Oktober 2023 änderte der Neuberger Berman Asian Debt – Hard Currency Fund seinen Namen in Neuberger Berman Responsible Asian Debt – Hard Currency Fund.

**Das Portfolio führte zum 2. Oktober 2023 eine Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen von 20 % ein. Die Angaben zu nachhaltigen Investitionen in dieser periodischen Berichtsvorlage wurden daher auf Grundlage der Portfoliobestände zum 31. Dezember 2023 (als das einzige Quartalsende nach Einführung der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen) erstellt. Die Zahlen zu den nachhaltigen Investitionen sind, bedingt durch die uneinheitlichen Bezugszeiträume, nicht in der Tabelle zur Vermögensallokation enthalten.

***Weitere Einzelheiten zum Mindestanteil nachhaltiger Investitionen, die ökologische oder soziale Merkmale bewerben, finden Sie unter der Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“.

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für Unternehmen beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und Landnutzung, Kohlenstoffemissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Wasserstress, Schadstoffemissionen und Abfälle, Finanzierung von Umweltauswirkungen, CO₂-Fußabdruck von Produkten, Umweltpolitik, Umweltmanagementsystem, Programme zur Reduzierung von THG-Emissionen („**THG**“) umweltfreundliche Beschaffungspolitik und Programme für treibhausfreie Luftemissionen.

Das Portfolio erreichte eine CO₂-Emissionsintensität, die mindestens 10 % unter derjenigen des breiteren Anlageuniversums asiatischer Schuldtitel lag, das bis zum 2. Oktober 2023 durch den JP Morgan Asian Credit Index (Total Return, USD) (der „**Referenzwert**“) repräsentiert wurde. Nach einer Erhöhung des Reduktionsziels (von 10 % auf 30 %) ab dem 2. Oktober 2024 erreichte das Portfolio eine Emissionsintensität, die mindestens 30 % unter derjenigen des breiteren Anlageuniversums für asiatische Schuldtitel lag. Das Portfolio wird aktiv verwaltet und beabsichtigt nicht, den Referenzwert nachzubilden (zu tracken). Er wird hier lediglich zu Zwecken des Vergleichs der Wertentwicklung herangezogen.

Für den Bezugszeitraum erreichte das Portfolio eine höhere ESG-Bewertung als das breitere Universum asiatischer Schuldtitel, das durch den Referenzwert repräsentiert wird, basierend auf den ESG-Bewertungen eines etablierten externen Anbieters.

Ab dem 2. Oktober 2023 soll das Portfolio auf ein Netto-Null-Ziel ausgerichtet sein. Der Sub-Investment-Manager bewarbt und bewirbt künftig die Verringerung des CO₂-Fußabdrucks des Portfolios in Bezug auf Scope-1-, Scope-2- und wesentliche Scope-3-Treibhausgasemissionen.¹ Es existiert kein jährliches Reduktionsziel. Stattdessen wird sich auf das Zwischenziel 2030 und das Netto-Null-Ziel 2050 konzentriert.

- **Soziale Merkmale:** Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Schutz der Privatsphäre und Datensicherheit, Produktsicherheit und -qualität, Sicherheit von Finanzprodukten, Diskriminierungspolitik, Programme zur Einbindung der Gemeinschaft, Diversitätsprogramme und Menschenrechtspolitik.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

¹Scope-1-Emissionen sind direkte Emissionen aus Quellen, die sich im Besitz des Emittenten befinden oder von ihm kontrolliert werden (z. B. Emissionen, die sich direkt durch die Geschäftsprozesse des Emittenten oder durch Fahrzeuge im Besitz des Emittenten ergaben). Scope-2-Emissionen sind indirekte Emissionen aus der Erzeugung von Strom, Dampf, Wärme und Kälte, die vom Emittenten verbraucht wurden. Scope-3-Emissionen sind alle anderen indirekten Emissionen, die in der Wertschöpfungskette eines Emittenten anfallen (u. a. Emissionen aus den vom Emittenten verbrauchten Produkten oder Dienstleistungen, aus der Entsorgung seiner Abfälle, aus dem Pendelverkehr seiner Mitarbeiter, aus dem Vertrieb und Transport seiner Produkte oder aus seinen Investitionen).

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses haben der Manager und der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „NB- ESG-Quotient“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten den NB-ESG-Quotienten, um die aufgeführten ökologischen und sozialen Merkmale zu bewerten, indem sie primär in Wertpapiere von Emittenten mit einem relativ günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotienten-Rating investierten. Dementsprechend beschränkten der Manager und der Sub-Investment-Manager das Engagement in Emittenten mit dem schlechtesten NB-ESG-Quotienten-Rating, außer es bestand die begründete Erwartung, dass sich das NB-ESG-Quotienten-Rating im Laufe der Zeit verbessern würde.

Der Bezugszeitraum ist ein Durchschnitt der vier Kalenderquartalsenden.

| Bezugszeitraum | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | 59 | 1-100 | 100 % |
| Daten von Dritten | 5,5 | 0-10 | |

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy und, seit dem 2. Oktober 2023, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren). Das Portfolio

baut sein Engagement in Kraftwerkskohle schrittweise ab und verbietet Investitionen in Wertpapiere von Emittenten, die mehr als 10 % ihrer Einnahmen aus dem Abbau von Kraftwerkskohle erzielen oder die neue Kohlekraftwerke ausbauen (wie durch interne Prüfungen festgestellt). Das Portfolio untersagte außerdem Investitionen in Emittenten aus der Kraftwerksindustrie, die mehr als 95 % ihrer installierten Kraftwerkskapazitäten aus Kraftwerkskohle bezogen, die in neue Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle expandierten oder deren Investitionsbudgets für Expansionszwecke keine Mindestschwelle für Investitionen in Nicht-Kohle enthielten (wie durch interne Prüfungen festgestellt).

Darüber hinaus wurden im Portfolio Wertpapiere aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen, die von Emittenten begeben wurden, die nachweislich an direkter Kinderarbeit beteiligt sind, die 5 % oder mehr ihrer Umsätze aus der Herstellung von Tabakerzeugnissen erzielen, sowie bestimmten Emittenten mit erheblichen Umsätzen aus Palmöl, Erwachsenenunterhaltung und Atomstromerzeugung oder seit dem 6. Dezember 2023 Unternehmen, die Brandwaffen unter Verwendung von weißem Phosphor herstellen oder eine Bezug zur Atomwaffenindustrie haben. Zudem investierte das Portfolio nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischen Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager schlossen seit dem 2. Oktober 2023

- (a) Wertpapiere von Emittenten aus, die 5% oder mehr ihrer Umsätze durch folgende Aktivitäten erzielen:
- die Herstellung alkoholischer Produkte;
 - die Herstellung von Material für Erwachsenenunterhaltung;
 - die Herstellung von konventionellen Waffen;
 - das Eigentum oder der Betrieb von mit Glücksspielen verbundenen Geschäften; oder
 - die Herstellung oder der Vertrieb von Palmöl.
- (b) Der Manager und der Sub-Investment-Manager schlossen Wertpapiere aus, die von Unternehmen begeben wurden, bei denen ESG-Kontroversen festgestellt wurden (unter anderem negative ESG-Auswirkungen der Geschäftstätigkeit, der Produkte und/oder Dienstleistungen des Unternehmens, Nichteinhaltung internationaler Richtlinien oder Schutzmaßnahmen (z. B. im Rahmen der Global Standards Policy)), oder von Unternehmen, die Anlass zu ernsthaften Bedenken hinsichtlich ihrer Anpassung an internationale Richtlinien oder Schutzmaßnahmen gaben.
- (c) Der Manager und der Sub-Investment-Manager tätigten keine Investitionen in staatlichen Emittenten und/oder in Unternehmen, die zu 100 % in staatlicher Hand sind, bei denen der Manager und der Sub-Investment-Manager eine schwache ESG-Praxis festgestellt haben. Diese Ausschlüsse basierten auf einer Reihe von ESG-Kriterien, darunter:
- Staatliche Emittenten, die auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten im untersten Dezil rangierten und bei denen keine Aussicht auf kurzfristige Verbesserungen bestanden; oder
 - Staatliche Emittenten, deren führende Vertreter vom UN-Sicherheitsrat aufgrund von Menschenrechtsverletzungen mit Sanktionen belegt wurden; oder
 - Staatliche Emittenten, bei denen schlechte und sich verschlechternde Kennzahlen für Menschenrechte und Rechtsstaatlichkeit festgestellt wurden; oder
 - staatliche Emittenten, die den vom Global Forum on Transparency and Exchange of Information for Tax Purposes der OECD aufgestellten Standard nicht einhielten, oder staatliche Emittenten, die von der Financial Action Task Force („**FATF**“) als Hochrisikoland eingestuft wurden.

Durch die oben genannten Maßnahmen basierend auf ESG-Ausschlüssen haben der Manager und der Sub-Investment-Manager mindestens 20 % der Komponenten des Anlageuniversums ausgeschlossen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich haben der Manager und der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise ihrer Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager erörterten und diskutierten die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund ihres eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlage des Portfolios).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. Der NB-ESG-Quotient

| | NB-ESG-Quotient-Rating | Rating der Daten durch externe Anbieter | Kombinierte Abdeckung |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| Bereich | 1-100 | 0-10 | 0-100 % |
| Bezugszeitraum 2022 | 59 | 5,6 | 97 % |
| Bezugszeitraum 2023 | 59 | 5,5 | 100 % |

Die Bewertung des NB-ESG-Quotienten ist im Vergleich zum Vorjahr unverändert geblieben.

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die Bewertung der Daten Dritter aufgrund von Veränderungen bei den gehaltenen Emittenten und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios sowie aufgrund von potenziellen Änderungen oder Unterschieden im externen Rating des Emittenten verlagert. Wie bereits erwähnt, werden der Manager und der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Emittenten eintreten, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient-Rating aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung im NB-ESG-Quotienten zu erreichen.

2. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

| | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|--------------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0 |
| Bezugszeitraum 2023 | 0 |

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Allerdings verpflichtete sich das Portfolio ab dem 2. Oktober 2023 zu einem Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen von 20 %, welche die vorstehend aufgeführten ökologischen und sozialen Merkmale bewerben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat (wie nachstehend erläutert) und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Emittenten, um festzustellen, ob der Emittent einer derartigen Beurteilung standhält. Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griffen der Manager und der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die wirtschaftlichen Tätigkeiten eines Emittenten auf ökologische oder soziale Merkmalen ausgerichtet waren.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager überprüften die Emittenten auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Emittenten diese Prüfung bestanden haben, haben der Manager und der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag des Emittenten zur Wirtschaft gemessen.

Bei Unternehmensemittenten haben der Manager und der Sub-Investment-Manager dies auf zwei Arten erfasst:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDGs“).

Bei staatlichen Emittenten haben der Manager und der Sub-Investment-Manager dies auf folgenden Arten erfasst:

- Fortschritte bei der Anpassung an den Klimawandel und dem Klimaschutz und
- Fortschritte bei der Erreichung der SDGs, mit Schwerpunkt auf Lebenserwartung und Bildung

Nachhaltige Investitionen wiesen zu einer höheren Wahrscheinlichkeit eine Ausrichtung der aus Produkten/Dienstleistungen erzielten Umsätze auf die SDGs auf.

Sowohl die nachhaltigen als auch die nicht nachhaltigen Investitionen im Portfolio zielten bis 2050 auf eine Netto-Null-Ausrichtung ab.

Die Berücksichtigung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs, nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers, wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griffen der Manager und der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Stellvertreterdaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltige Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Ab dem 2. Oktober 2023 wandten der Manager und der Sub-Investment-Manager ihren Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigen. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und auf Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Bei der Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen kein ökologisches oder soziales nachhaltiges Anlageziel erheblich beeinträchtigten, berücksichtigten der Manager und der Sub-Investment-Manager die in Teil 1 der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen für Unternehmensemittenten (die „**PAIs für Unternehmensemittenten**“) und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen für staatliche Emittenten (die „**staatlichen PAIs**“) wie nachfolgend in Teil 2 der Tabelle dargelegt (zusammen die „**PAIs**“):

| Teil 1 – PAIs für Unternehmensemittenten | |
|---|---|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgasemissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind PAI 5 - Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren |
| <i>Biodiversität</i> | PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken |
| <i>Wasser</i> | PAI 8 - Emissionen in Wasser |
| <i>Abfall</i> | PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |
| Teil 2 – staatliche PAIs | |
| <i>Umwelt</i> | PAI 15 - THG-Emissionsintensität |
| <i>Soziales</i> | PAI 16 - Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen |

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten ferner Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen und investierte nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

— — — *Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Manager und den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Emittenten, die quantitative und qualitative Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden, unterschreiten;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Emittenten, wenn sie unter die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

— — — *Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:*

Der Manager und der Sub-Investment-Manager investierten nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager und den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „*Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?*“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Anlageziele führten, ab dem 2. Oktober 2023 alle PAIs berücksichtigt.
2. Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| PAIs auf Produktebene | |
|-----------------------------------|---|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgas-emissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen |

PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen

PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager und den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem über die vier Kalenderquartalsenden des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitt basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|---|---|-------------------------|-------------|
| INDONESIA (REPUBLIC OF) RegS | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 2,3 % | Indonesien |
| PERTAMINA PT RegS | G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 2,0 % | Indonesien |
| INDONESIA REPUBLIC OF | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,2 % | Indonesien |
| INDONESIA (REPUBLIC OF) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,2 % | Indonesien |
| MONGOLIA (GOVERNMENT OF) RegS | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,1 % | Mongolei |
| PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA MTN RegS | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 0,9 % | Indonesien |
| PHILIPPINES (REPUBLIC OF) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 0,9 % | Philippinen |
| ENN CLEAN ENERGY INTERNATIONAL INV RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 0,9 % | China |
| STANDARD CHARTERED PLC RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 0,8 % | Hongkong |

| | | | | |
|------------------------------------|------|---|-------|----------------|
| SRI LANKA GOVERNMENT BOND | RegS | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 0,8 % | Sri Lanka |
| RENEW POWER PVT LTD | RegS | D – Energieversorgung | 0,8 % | Indien |
| MEDCO BELL PTE LTD | RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 0,8 % | Indonesien |
| EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA | | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 0,7 % | Republik Korea |
| STANDARD CHARTERED PLC | RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 0,7 % | Hongkong |
| SRI LANKA (DEMOCRATIC SOCIALIST RE | | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 0,7 % | Sri Lanka |

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

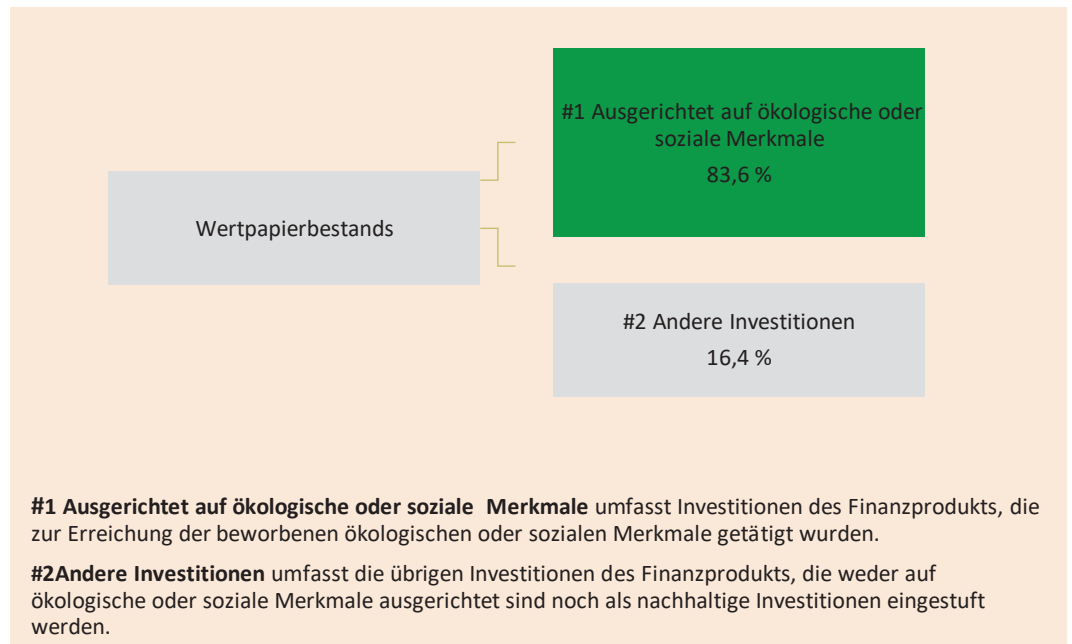
Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 83,6 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio führte zum 2. Oktober 2023 eine Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen von 20 % ein. Die Angaben zu nachhaltigen Investitionen in dieser periodischen Berichtsvorlage wurden daher auf Grundlage der Portfoliobestände zum 31. Dezember 2023 (als das einzige Quartal nach Einführung der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen) erstellt. Das Portfolio hielt 48 % an nachhaltigen Investitionen.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 16,4 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berechneten den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager und der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatten. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Der Bezugszeitraum für die nachstehenden Daten ist ein Durchschnitt der vier Quartalsenden 2023, mit Ausnahme der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen. In

diesem Falle wurden die Daten lediglich für diesen Bezugszeitraum auf Grundlage der Portfoliobeteiligungen zum 31. Dezember 2023 erstellt.



Der prozentuale Anteil der nachhaltigen Investitionen zum 31. Dezember 2023 betrug 48,0 %. Darin enthalten waren 38,7 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, und 9,3 % an sozial nachhaltigen Investitionen. Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Bildung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalender quartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|--|-------------------------|
| B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden | 1,0 % |
| C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 8,2 % |
| D – Energieversorgung | 6,5 % |
| F – Baugewerbe/Bau | 2,1 % |
| G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 4,6 % |

| | |
|---|--------|
| H - Verkehr und Lagerei | 2,3 % |
| I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie | 0,7 % |
| J – Information und Kommunikation | 3,3 % |
| K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 50,9 % |
| M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen | 0,9 % |
| N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 2,1 % |
| O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 14,7 % |
| R – Kunst, Unterhaltung und Erholung | 1,5 % |
| Keine | 1,3 % |

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: *Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.*



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine 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?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager können bestätigen, dass das Portfolio in Investitionen investiert hat, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager und der Sub-Investment-Manager werden das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert²?

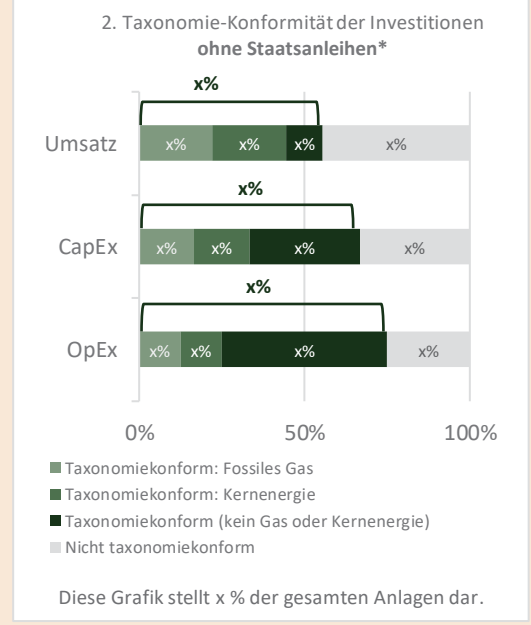
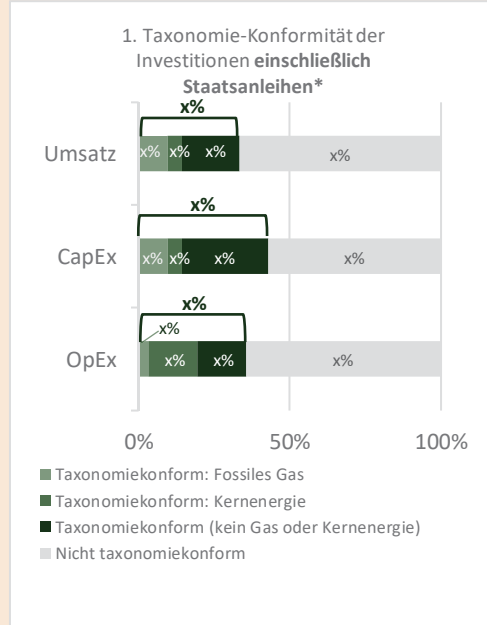
- Ja: In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

² Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Das Portfolio führte zum 2. Oktober 2023 eine Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen von 20 % ein. Die Angaben zu nachhaltigen Investitionen in dieser periodischen Berichtsvorlage wurden daher auf Grundlage der Portfoliobestände zum 31. Dezember 2023 (als das einzige Quartalsende nach Einführung der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen) erstellt. Zum 31. Dezember 2023 hielt das Portfolio 38,7 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden.



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?

Das Portfolio führte zum 2. Oktober 2023 eine Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen von 20 % ein. Die Angaben zu nachhaltigen Investitionen in dieser periodischen Berichtsvorlage wurden daher auf Grundlage der Portfoliobestände zum 31. Dezember 2023 (als das einzige Quartalsende nach Einführung der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen) erstellt. Zum 31. Dezember 2023 hielt das Portfolio 9,3 % an sozial nachhaltigen Investitionen.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager und der Sub-Investment-Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachteten, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards

verstoßen, verhinderten und sie sicherstellen, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager wendeten bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager verstehen unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Managers und des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers und des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager und vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager engagierten sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager betrachteten diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil ihres Anlageprozesses. Die Fortschritte bei der Einbindung wurden vom Manager und dem Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wendete das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund (das „Portfolio“)

Unternehmenskennung: 549300J30SXW5866TW70

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 36.5 %* an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

*Weitere Einzelheiten zum Mindestanteil nachhaltiger Investitionen, die ökologische oder soziale Merkmale bewerben, finden Sie unter der Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“.

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „Bezugszeitraum“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für staatliche Emittenten beworben:

- **Ökologische Merkmale:** staatliche Energieeffizienz, Anpassung an den Klimawandel, Entwaldung, Treibhausgasemissionen („THG“) , Luft- und Haushaltsverschmutzung und unsichere sanitäre Einrichtungen.
- **Soziale Merkmale:** Fortschritte bei den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, "SDGs"), Gesundheits- und Bildungsniveau, Qualität der Regulierung, politische Stabilität und Freiheiten, Gleichstellung der Geschlechter sowie Forschung und Entwicklung.

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für Unternehmensemittenten beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und Landnutzung, Kohlenstoffemissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Wasserstress, Schadstoffemissionen und Abfälle, Finanzierung von Umweltauswirkungen, CO₂-Fußabdruck von Produkten, Umweltpolitik, Umweltmanagementsystem, Programme zur Reduzierung von THG-Emissionen, umweltfreundliche Beschaffungspolitik und Programme für treibhausfreie Luftemissionen.
- **Soziale Merkmale:** Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Schutz der Privatsphäre und Datensicherheit, Produktsicherheit und -qualität, Sicherheit von Finanzprodukten, Diskriminierungspolitik, Programme zur Einbindung der Gemeinschaft, Diversitätsprogramme und Menschenrechtspolitik.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses haben der Manager und der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „NB- ESG-Quotient“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für Länder und Unternehmenssektoren, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating abzuleiten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten den NB-ESG-Quotienten, um die aufgeführten ökologischen und sozialen Merkmale zu bewerten, indem sie primär in Wertpapiere von Emittenten mit einem relativ günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotienten-Rating investierten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend beschränkten der Manager und der Sub-Investment-Manager das Engagement in Emittenten mit dem schlechtesten NB-ESG-Quotienten-Rating, außer es bestand die begründete Erwartung, dass sich das NB-ESG-Quotienten-Rating im Laufe der Zeit verbessern würde.

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Bezugszeitraum | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | 56 | 1-100 | 98 % |
| Daten von Dritten | 4,5 | 0-10 | |

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Das Portfolio baut sein Engagement in Kraftwerkskohle schrittweise ab und verbietet Investitionen in Wertpapiere von Emittenten, die mehr als 10 % ihrer Einnahmen aus dem Abbau von Kraftwerkskohle erzielten oder die neue Kohlekraftwerke ausbauten (wie durch interne Prüfungen festgestellt). Ab dem 6. Dezember 2023 schlossen der Manager und der Sub-Investment-Manager Unternehmen aus dem Anlageuniversum aus, die Brandwaffen unter Verwendung von weißem Phosphor herstellten oder einen Bezug zur Atomwaffenindustrie hatten. Ab dem 6. Dezember 2023 schlossen der Manager und der Sub-Investment-Manager Wertpapiere von Unternehmen aus, die 5 % oder mehr ihrer Umsätze aus der Herstellung von Material für die Erwachsenenunterhaltung oder der Herstellung konventioneller Waffen erzielten. Das Portfolio untersagte außerdem Investitionen in Emittenten aus der Kraftwerksindustrie, die mehr als 95 % ihrer installierten Kraftwerkskapazitäten aus Kraftwerkskohle bezogen, die in neue Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle expandierten oder deren Investitionsbudgets für Expansionszwecke keine Mindestschwelle für Investitionen in Nicht-Kohle enthielten (wie durch interne Prüfungen festgestellt). Zudem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstößend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen. Darüber hinaus schloss das Portfolio Wertpapiere von Emittenten aus, die 5 % oder mehr ihrer Umsätze aus der Herstellung von Tabakerzeugnissen erzielten. Emittenten, die an direkter Kinderarbeit beteiligt waren, und Emittenten, die mehr als 10 % der Umsätze aus der Ölsandgewinnung erzielten, wurden ebenfalls ausgeschlossen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstießen. Wo möglich haben der Manager und der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten

Dritter mit der qualitativen Expertise ihrer Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager erörterten und diskutierten die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund ihres eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. Der NB-ESG-Quotient

| | NB-ESG-Quotient-Rating | Rating der Daten durch externe Anbieter | Kombinierte Abdeckung |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| Bereich | 1-100 | 0-10 | 0-100 % |
| Bezugszeitraum 2022 | 55 | 4,2 | 95 % |
| Bezugszeitraum 2023 | 56 | 4,5 | 98 % |

Die Bewertung des NB-ESG-Quotienten hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

Das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen sowie auf potenzielle Änderungen oder Unterschiede im externen Emittenten-Rating.

2. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

| | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|--------------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0 |
| Bezugszeitraum 2023 | 0 |

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckt sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Investition zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Investition eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat (wie nachstehend erläutert) und (iii) eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die Unternehmensführung eines Emittenten, um festzustellen, ob der Emittent einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griffen der Manager und der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die wirtschaftlichen Tätigkeiten eines Emittenten auf ökologische oder soziale Merkmalen ausgerichtet waren.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager überprüften die Emittenten auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Emittenten diese Prüfung bestanden haben, haben der Manager und der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag des Emittenten zur Wirtschaft gemessen.

Bei Unternehmensemittenten haben der Manager und der Sub-Investment-Manager dies auf zwei Arten erfasst:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen („SDGs“).

Die Berücksichtigung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs, nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers, war durch die Verfügbarkeit von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griffen der Manager und der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Stellvertreterdaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

Bei staatlichen Emittenten haben der Manager und der Sub-Investment-Manager dies auf folgenden Arten erfasst:

- Fortschritte bei der Anpassung an den Klimawandel und dem Klimaschutz und
- Fortschritte bei der Erreichung der SDGs, mit Schwerpunkt auf Lebenserwartung und Bildung

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager wandten ihren Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigten. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachteten der Manager und der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Bei der Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Anlagen kein ökologisches oder soziales nachhaltiges Anlageziel erheblich beeinträchtigten, berücksichtigten der Manager und der Sub-Investment-Manager die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „**PAIs**“) und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen für staatliche Emittenten (wie nachfolgend in Teil 2 der Tabelle im Abschnitt „*Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*“ dargelegt) (die „**staatlichen PAIs**“):

| PAIs | |
|-----------------------------------|---|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgas-emissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind PAI 5 - Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren |
| <i>Biodiversität</i> | PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken |
| <i>Wasser</i> | PAI 8 - Emissionen in Wasser |
| <i>Abfall</i> | PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager investierten nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

— — —

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Manager und den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Emittenten, die quantitative und qualitative Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden, unterschreiten;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Emittenten, wenn sie unter die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

— — —

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager investierten nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager und den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs und staatlichen PAIs berücksichtigt.
2. Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten in Bezug auf die Nachhaltigkeitsfaktoren die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 1 der nachstehenden Tabelle für Unternehmensemittenten (die „**PAIs für Unternehmensemittenten**“), und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 2 der nachstehenden Tabelle für staatliche Emittenten (die „**staatlichen PAIs**“) (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“) aufgeführt sind:

| Teil 1 – PAIs für Unternehmensemittenten | |
|---|---|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgas-emissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen |
| Teil 2 – staatliche PAIs | |
| <i>Umwelt</i> | PAI 15 - THG-Emissionsintensität |
| <i>Soziales</i> | PAI 16 - Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbareren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager und den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|---|---|-------------------------|-------------------------|
| SERBIA (REPUBLIC OF) RegS | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,7 % | Republik Serbien |
| REPUBLIC OF COLOMBIA | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,5 % | Kolumbien |
| SOUTHERN GAS CORRIDOR CJSC RegS | H - Verkehr und Lagerung | 1,2 % | Aserbaidschan |
| BRAZIL MINAS SPE RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 1,2 % | Brasilien |
| ANGOLA GOVERNMENT BOND RegS | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,1 % | Angola |
| PETROLEOS MEXICANOS | B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden | 1,0 % | Mexiko |
| QNB FINANCE LTD MTN RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 1,0 % | Katar |
| EASTERN AND SOUTHERN AFRICAN TRADE MTN RegS | U – Exterritoriale Organisationen und Körperschaften | 1,0 % | Supranational |
| COLOMBIA GOVERNMENT BOND | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 0,9 % | Kolumbien |
| SAUDI ARABIAN OIL CO MTN RegS | B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden | 0,9 % | Saudi-Arabien |
| KOREA MINE REHABILITATION AND MINE RegS | B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden | 0,9 % | Republik Korea |
| SASOL FINANCING USA LLC | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 0,8 % | Südafrika |
| ARAB REPUBLIC OF EGYPT MTN RegS | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 0,8 % | Ägypten |
| DOMINICAN REPUBLIC RegS | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 0,8 % | Dominikanische Republik |
| ROMANIA (REPUBLIC OF) MTN RegS | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 0,7 % | Rumänien |

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.



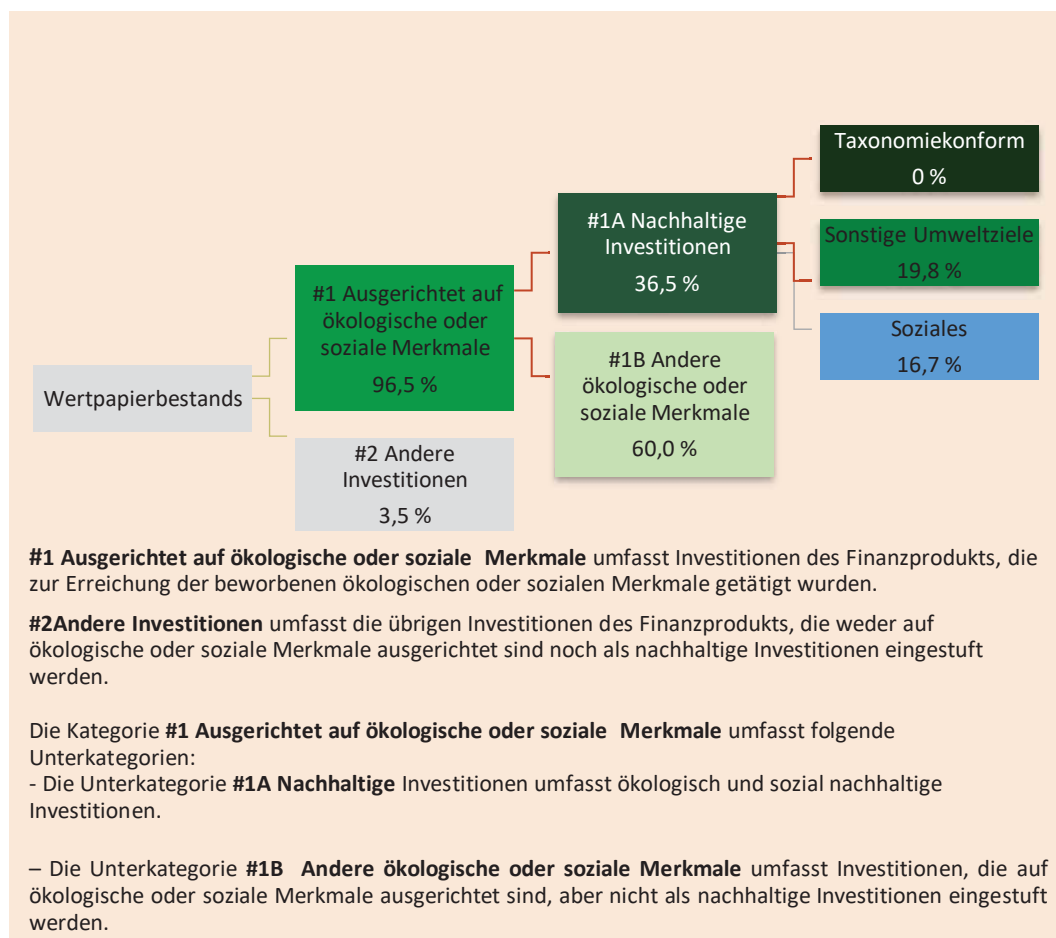
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 96,5 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio verpflichtete sich, mindestens 10 % nachhaltige Investitionen zu halten. Während des Bezugszeitraums 2023 hielt das Portfolio 36,5 % an nachhaltigen Investitionen.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 3,5 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berechneten den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager und der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatten. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|--|-------------------------|
| B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden | 9,1 % |
| C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,7 % |
| D – Energieversorgung | 3,6 % |
| E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen | 0,0 % |
| F – Baugewerbe/Bau | 0,8 % |
| G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 0,4 % |
| H - Verkehr und Lagerei | 2,7 % |
| I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie | 0,6 % |
| J – Information und Kommunikation | 0,3 % |
| K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 48,9 % |
| L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 0,7 % |
| M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen | 0,1 % |
| N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 0,6 % |
| O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 27,2 % |

| | |
|---|-------|
| R – Kunst, Unterhaltung und Erholung | 0,7 % |
| U – Extraterritoriale Organisationen und Körperschaften | 1,3 % |
| Keine | 0,2 % |

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglicht darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den 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.

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager können bestätigen, dass das Portfolio in Investitionen investiert hat, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager und der Sub-Investment-Manager werden das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessert.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

- Ja:

 In fossiles Gas In Kernenergie

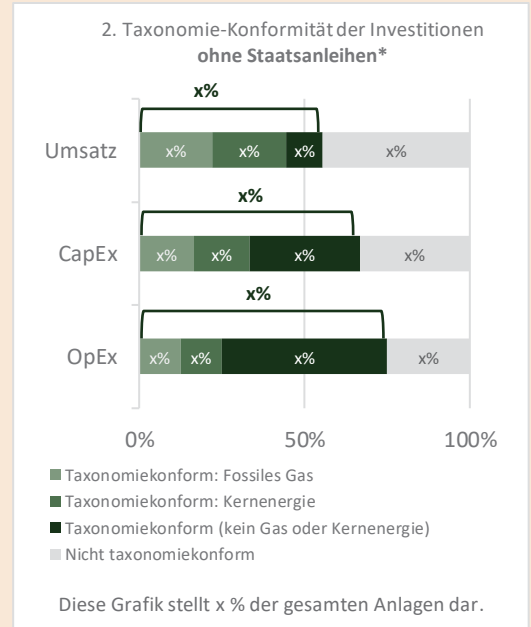
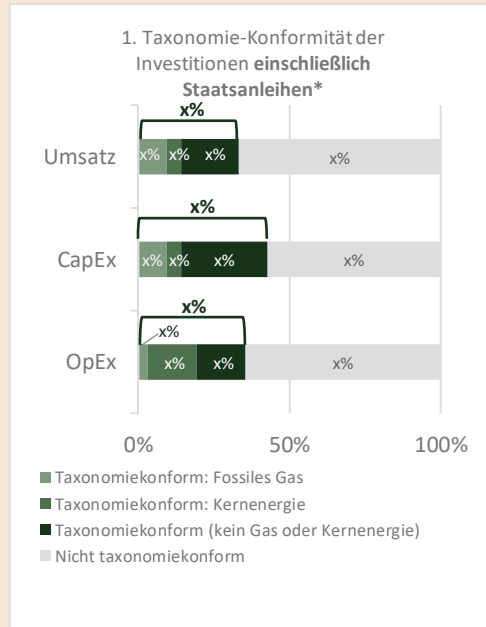
 Nein

¹ Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Das Portfolio hielt 19,8 % an nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel.



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?

Das Portfolio hielt 16,7 % an sozial nachhaltigen Investitionen.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager und der Sub-Investment-Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachteten, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen, verhinderten und sie sicherstellen, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager wendeten bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager verstehen unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Managers und des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers und des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager und vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager engagierten sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager betrachteten diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil ihres Anlageprozesses. Die Fortschritte bei der Einbindung wurden vom Manager und dem Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

k.A.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

k.A.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

k.A.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Short Duration High Yield SDG Engagement Fund (das „Portfolio“)

Unternehmenskennung: 5493009EN8Z7034TFP15

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Nein

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 28,8* % an nachhaltigen Investitionen**

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben**, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

*Das Portfolio führte zum 2. August 2023 eine Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen von 10 % ein. Die Angaben zu nachhaltigen Investitionen in dieser periodischen Berichtsvorlage wurden daher auf Grundlage des Durchschnitts aus den Werten zum Ende des dritten und vierten Quartals 2023 (als die einzigen Quartalsenden nach Einführung der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen) erstellt. Die Zahlen zu den nachhaltigen Investitionen sind, bedingt durch die uneinheitlichen Bezugszeiträume, nicht in der Tabelle zur Vermögensallokation enthalten.

**Weitere Einzelheiten zur Vermögensallokation des Portfolios (einschließlich des Engagements in nachhaltigen Investitionen) finden Sie nachfolgend unter der Frage „Wie hoch war der Anteil der *nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen*?“.

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Das Portfolio war bestrebt, die Verwirklichung der UN-Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDGs“) zu bewerben, indem mit mindestens 90 % der Emittenten (innerhalb von zwölf Monaten im Anschluss an den Kauf der von dem Unternehmensemittenten begebenen Wertpapiere) Kontakt aufgenommen und Maßnahmen besprochen wurden, die sie im Rahmen ihrer Produkte, Dienstleistungen, betrieblichen Abläufe oder Prozesse ergreifen können und die mit diesen Zielen in Einklang stehen (oder wo das Potenzial besteht, dass nach einer Zusammenarbeit mit diesen Unternehmen eine stärkere Ausrichtung auf diese Ziele erreicht wird).

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO₂-Fußabdrucks*, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, Recycling-Praktiken und -Trends, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.

Um das Portfolio auf ein Null-Nettoziel auszurichten, bewarb und bewirbt der Sub-Investment-Manager die Verringerung des CO₂-Fußabdrucks des Portfolios in den Scope-1-, Scope-2- und wesentlichen Scope-3-THG-Emissionen¹. Damit soll das Ziel des Portfolios erreicht werden, bis 2030 eine Verringerung um 50 % im Vergleich zu einem als Basiswert angenommenen Jahr (2019) und einen anschließenden Rückgang auf Null netto bis 2050 erreicht werden. Das Basisjahr 2019 kann neu berechnet werden, wenn sich die Datenqualität und die Offenlegung im Laufe der Zeit verbessern, insbesondere in Bezug auf die Scope-3-Emissionen.

- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen zur Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Der Sub-Investment-Manager hielt für den Berichtszeitraum ein durchschnittliches ESG-Rating für das Portfolio aufrecht, das besser war als das des breiten US-Hochzinsmarktes, der durch den ICE BofA U.S. High Yield Index repräsentiert wird, was auf der Grundlage von ESG-Ratings Dritter von einem etablierten externen Anbieter bewertet wurde. Der Bezugszeitraum ist ein Durchschnitt der vier Kalenderquartalsenden. Das Portfolio wurde aktiv verwaltet, der ICE BofA U.S. High Yield Index wurde ausschließlich zum Vergleich von ESG-Ratings und der Reduzierung der Kohlenstoffintensität verwendet.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

¹Scope-1-Emissionen sind direkte Emissionen aus Quellen, die sich im Besitz des Emittenten befinden oder von ihm kontrolliert werden (z. B. Emissionen, die sich direkt durch die Geschäftsprozesse des Emittenten oder durch Fahrzeuge im Besitz des Emittenten ergaben). Scope-2-Emissionen sind indirekte Emissionen aus der Erzeugung von Strom, Dampf, Wärme und Kälte, die vom Emittenten verbraucht wurden. Scope-3-Emissionen sind alle anderen indirekten Emissionen, die in der Wertschöpfungskette eines Emittenten anfallen (u. a. Emissionen aus den vom Emittenten verbrauchten Produkten oder Dienstleistungen, aus der Entsorgung seiner Abfälle, aus dem Pendelverkehr seiner Mitarbeiter, aus dem Vertrieb und Transport seiner Produkte oder aus seinen Investitionen).

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von NB, die sich auf die ESG-Merkmale konzentrierte, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen. Jedes Sektorkriterium wurde unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteten ESG-Daten erstellt. Ergänzend kamen interne qualitative Analysen hinzu, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams des Sub-Investment-Managers genutzt wurde.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergriffen hat, wurden aus dem Portfolio entfernt.

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Bezugszeitraum | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|--------------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | 57 | 1-100 | 100 % |
| Daten von Dritten | 5,6 | 0-10 | |

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 das niedrigste und 100 das höchste Rating darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Berichterstattung über die Zusammenarbeit:

Wie oben erwähnt, trug der Sub-Investment-Manager zur Erreichung der SDGs bei, indem er mit mindestens 90 % der Unternehmensemittenten in Kontakt trat (die zum 31. Dezember 2023 für mindestens zwölf Monate im Portfoliobestand waren).

Der Sub-Investment-Manager hat außerdem nachfolgend eine Zusammenfassung seiner Bemühungen zur Einflussnahme im Kalenderjahr 2023 beigefügt.

| |
|---|
| Der Sub-Investment-Manager trat mit 161 im Portfolio gehaltenen Unternehmen während des Bezugszeitraus in Kontakt. |
| 54 % dieser Dialoge des Sub-Investment-Managers waren direkte Einzelgespräche (entweder per Fernzugriff oder als persönliches Gespräch). |
| 51 % der Gespräche des Sub-Investment-Managers fanden mit Mitarbeitern und Mitarbeiterinnen der CEO-/CFO-Ebene statt. |
| 15 der insgesamt 17 UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, „SDG“) wurden vom Sub-Investment-Manager während seiner Zusammenarbeit mit den Unternehmen abgedeckt. |
| 22 % der Unternehmen, mit denen im Bezugszeitraum zusammengearbeitet wurde, haben das Ziel dieser Mitwirkung entweder vollständig erreicht oder teilweise Maßnahmen zur Erreichung ihres Ziels ergriffen. |

Weitere Informationen über die Einflussnahme durch den Sub-Investment-Manager finden sich in der Bericht des Portfolios über die Zusammenarbeit [hier](#).

3. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmensemittenten gemessen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und Chancen durch den Klimawandel pro Emission und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit eine Emission durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 11,6 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 59 %, was aus dem Durchschnitt der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet wurde.

Die Analyse des CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

4. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy und die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren). Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen. Das Portfolio hat Emittenten ausgeschlossen, die an umstrittenen Tätigkeiten und Verhaltensweisen beteiligt waren, darunter Hersteller von Pelz, Glücksspielunternehmen und im Bereich Kernkraft tätige Unternehmen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlage des Portfolios).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. Der NB-ESG-Quotient

| | NB-ESG-Quotient-Rating | Rating der Daten durch externe Anbieter | Kombinierte Abdeckung |
|----------------|------------------------|---|-----------------------|
| Bereich | 1-100 | 0-10 | 0-100 % |

| | | | |
|----------------------------|----|-----|-------|
| Bezugszeitraum 2022 | 57 | 5,3 | 100 % |
| Bezugszeitraum 2023 | 57 | 5,6 | 100 % |

Im Vergleich zum Vorjahr ist die Bewertung des NB-ESG-Quotienten unverändert geblieben und die Bewertung der Daten Dritter hat sich verbessert. Dies ist unter Umständen auf eine Verbesserung bei den einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten gemäß externem Datenanbieter oder auf Differenzen im von dem Anbieter bereitgestellten externen Rating des Emittenten zurückzuführen.

2. Berichterstattung über die Zusammenarbeit

| | Unternehmen, mit denen zusammen-gearbeitet wurde | % der Dialoge waren direkte Einzel-gespräche (entweder per Fernzugriff oder als persönliches Gespräch) | % der Dialoge erfolgten mit Mitarbeiter/innen auf CEO/CFO-Ebene | Anzahl der abgedeckten SDGs (von 17) | % der Unternehmen, mit denen zusammen-gearbeitet wurde, haben das Ziel dieser Mitwirkung entweder vollständig erreicht oder teilweise Maßnahmen zur Erreichung ihres Ziels ergriffen. |
|----------------------------|---|---|--|---|--|
| Bezugszeitraum 2022 | 114 | 65 % | 48 % | 14 | 16 % |
| Bezugszeitraum 2023 | 161 | 54 % | 51 % | 15 | 22 % |

3. CVaR

| | CVaR | Abdeckung |
|----------------------------|-------------|------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | -12,4 % | 60 % |
| Bezugszeitraum 2023 | -11,6 % | 59 % |

Der durch die CVaR prognostizierte Verlust hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmensemittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

4. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

| | Gesamtzahl der Verstöße |
|---------------------|-------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0 |
| Bezugszeitraum 2023 | 0 |

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es während des Bezugszeitraums kein nachhaltiges Anlageziel. Seit dem 2. August 2023 hat sich das Portfolio dazu verpflichtet, mindestens 10 % nachhaltige Investitionen zu halten. Die nachhaltigen Investitionen bewarben die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat (wie nachstehend erläutert) und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Emittenten, um festzustellen, ob der Emittent einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Emittenten auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Sub-Investment-Manager überprüfte die Emittenten auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Emittenten diese Prüfung bestanden haben, hat der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag des Emittenten zur Wirtschaft gemessen.

Der Sub-Investment-Manager erfasste dies auf zwei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbaren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Seit dem 2. August 2023 wendet der Sub-Investment-Manager seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigen. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „PAIs“):

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

| PAIs | |
|-----------------------------------|---|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgasemissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind PAI 5 - Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren |
| <i>Biodiversität</i> | PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken |
| <i>Wasser</i> | PAI 8 - Emissionen in Wasser |
| <i>Abfall</i> | PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte ferner Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen und investierte nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

— — — *Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Emittenten, die quantitative und qualitative Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI festgelegt wurden, unterschreiten;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Emittenten, wenn sie unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

— — — *Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:*

Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „*Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?*“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.
2. Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| PAIs auf Produktebene | |
|--------------------------------|---|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgas-emissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |

| | |
|-----------------------------------|---|
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | <p>PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen</p> <p>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen</p> <p>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)</p> |
|-----------------------------------|---|

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbar Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die o. g. PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|---|--|-------------------------|-------------|
| XHR LP 144A | L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 1,3 % | USA |
| AVIENT CORP 144A | G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 1,0 % | USA |
| GEN DIGITAL INC 144A | J – Information und Kommunikation | 1,0 % | USA |
| STANDARD INDUSTRIES INC (DELAWARE) 144A | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 1,0 % | USA |
| APX GROUP INC 144A | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 0,9 % | USA |
| SOLARIS MIDSTREAM HOLDINGS LLC 144A | H - Verkehr und Lagerung | 0,9 % | USA |
| AMERICAN AIRLINES INC 144A | H - Verkehr und Lagerung | 0,9 % | USA |
| PERFORMANCE FOOD GROUP INC 144A | G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 0,9 % | USA |
| GENESIS ENERGY LP | B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden | 0,9 % | USA |
| TRIVIMUM PACKAGING FINANCE BV 144A | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 0,9 % | Niederlande |
| PARK INTERMEDIATE HOLDINGS LLC 144A | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 0,8 % | USA |
| ASSUREDPARTNERS INC 144A | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 0,8 % | USA |

| | | | |
|------------------------------------|--|-------|-----|
| AMERICAN AIRLINES INC 144A | H - Verkehr und Lagerung | 0,8 % | USA |
| RLJ LODGING TRUST LP 144A | L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 0,8 % | USA |
| CAMELOT RETURN MERGER SUB INC 144A | N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 0,8 % | USA |



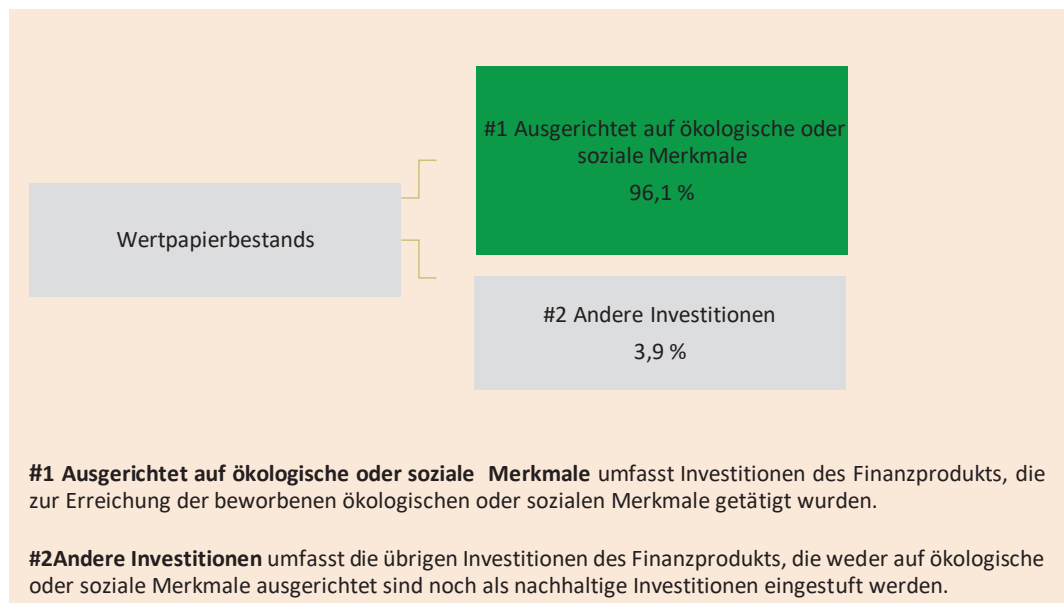
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 96,1 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio führte zum 2. August 2023 eine Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen von 10 % ein. Die Angaben zu nachhaltigen Investitionen in diesem periodischen Bericht wurden daher auf Grundlage der Portfoliobestände als Durchschnitt zum dritten und vierten Quartalsende des Bezugszeitraums (als die einzigen Quartalsenden nach Einführung der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen) erstellt. Das Portfolio hielt 28,8 % an nachhaltigen Investitionen.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 3,9 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Der Bezugszeitraum für die nachstehenden Daten ist ein Durchschnitt der vier Kalenderquartalsenden, mit Ausnahme der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen. In diesem Falle wurden die Daten lediglich für diesen Bezugszeitraum auf Grundlage des Durchschnitts zum Ende des dritten und vierten Quartals erstellt.



Der prozentuale Anteil der nachhaltigen Investitionen als Durchschnitt des dritten und vierten Quartals 2023 beträgt 28,8 %. Darin enthalten sind 17,5 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind, und 11,3 % an sozial nachhaltigen Investitionen. Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Bildung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|--|-------------------------|
| B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden | 7,0 % |
| C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 17,8 % |
| D – Energieversorgung | 2,6 % |
| E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen | 0,5 % |
| F – Baugewerbe/Bau | 2,7 % |
| G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 6,3 % |
| H – Verkehr und Lagerei | 9,7 % |
| I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie | 0,4 % |
| J – Information und Kommunikation | 13,7 % |
| K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 19,4 % |
| L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 4,2 % |
| M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen | 1,0 % |
| N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 7,4 % |
| Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen | 3,2 % |
| R – Kunst, Unterhaltung und Erholung | 1,3 % |
| S – Sonstige Dienstleistungen | 0,0 % |
| Keine | 2,8 % |



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine 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?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert²?

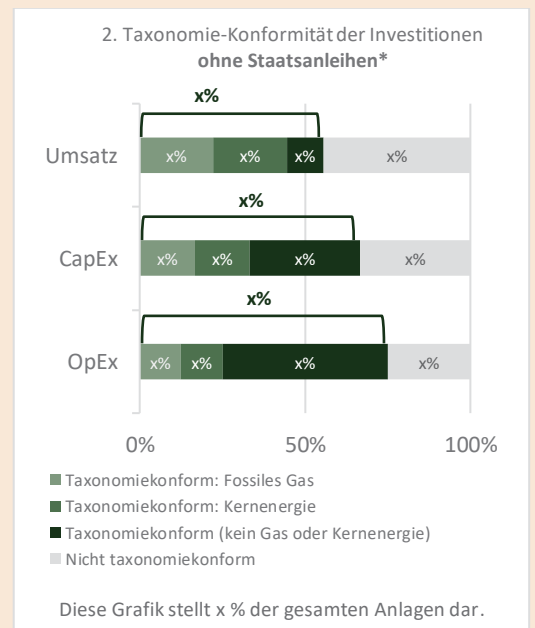
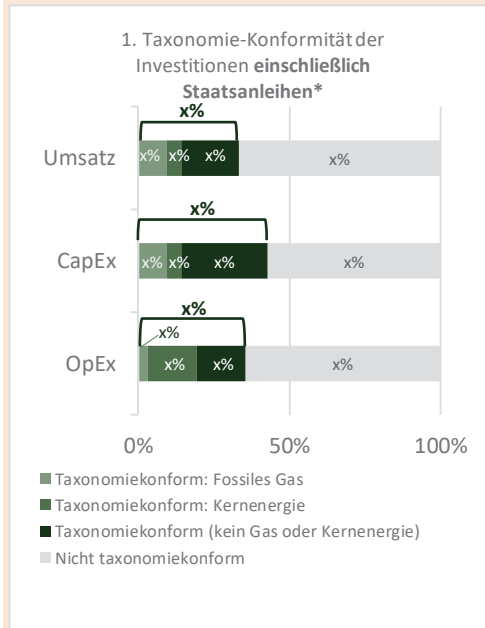
- Ja:
- In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

² Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Das Portfolio führte zum 2. August 2023 eine Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen von 10 % ein. Die Angaben zu nachhaltigen Investitionen in dieser periodischen Berichtsvorlage wurden daher auf Grundlage des Durchschnitts zum dritten und vierten Quartalsende des Bezugszeitraums (als die einzigen Quartalsenden nach Einführung der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen) erstellt. Das Portfolio hielt 17,5 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, das nicht mit der EU-Taxonomie konform ist.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Das Portfolio führte zum 2. August 2023 eine Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen von 10 % ein. Die Angaben zu nachhaltigen Investitionen in dieser periodischen Berichtsvorlage wurden daher auf Grundlage des Durchschnitts zum dritten und vierten Quartalsende des Bezugszeitraums (als die einzigen Quartalsenden nach Einführung der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen) erstellt. Das Portfolio hielt 11,3 % an sozial nachhaltigen Investitionen.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittentenanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses.

Dieses Programm konzentrierte sich auf persönliche Treffen und Telefonkonferenzen, um die ESG-Risiken und -Chancen zu verstehen und die gute Unternehmensführung der Emittenten zu bewerten. Im Rahmen der direkten Zusammenarbeit hat der Sub-Investment-Manager Ziele festgelegt, welche Ziele die Emittenten erreichen sollten. Diese Ziele sowie die Fortschritte der Emittenten im Hinblick auf diese Ziele wurden vom Sub-Investment-Manager mit Hilfe eines internen Systems von NB zur Nachverfolgung der Mitwirkung erfasst und überwacht (weitere Einzelheiten sind dem obigen Abschnitt über die Mitwirkung zu entnehmen).

Das Portfolio:

- Bestrebt, die Verwirklichung der SDGs zu bewerben, indem darauf abgezielt wurde, mit mindestens 90 % der Emittenten (innerhalb von zwölf Monaten im Anschluss an den Kauf der von dem Emittenten begebenen Wertpapiere) Kontakt aufzunehmen und Maßnahmen zu besprechen, die sie im Rahmen ihrer Produkte, Dienstleistungen, betrieblichen Abläufe oder Prozesse ergreifen könnten und die mit diesen Zielen in Einklang stehen (oder wo das Potenzial besteht, dass nach einer Zusammenarbeit mit diesen Emittenten eine stärkere Ausrichtung auf diese Ziele erreicht wird).
- Hielt ein durchschnittliches ESG-Rating für das Portfolio aufrecht, das besser war als das des breiten US-Hochzinsmarktes, der durch den ICE BofA U.S. High Yield Index repräsentiert wird und der auf der Grundlage von ESG-Ratings Dritter von einem etablierten externen Anbieter bewertet wurde. Diese Berechnung basierte auf dem ESG-Rating des Portfolios zum Ende eines jeden der vier Kalenderquartale im Bezugszeitraum.

Der Sub-Investment-Manager nutzte ein hausinternes Instrument, um im Vorfeld einer Anlage die Wahrscheinlichkeit auf Erfolg bei der Mitwirkung gegenüber einem Emittenten festzustellen (der „**Mitwirkungspotenzial-Indikator**“). Der Mitwirkungspotenzial-Indikator bietet auf einer Skala von 1–5 eine systematische Bewertung der Bereitschaft und Fähigkeit eines Emittenten, mit dem Sub-Investment-Manager zu den SDGs zusammenzuarbeiten. Ein Emittent, der beispielsweise als nicht bereit oder fähig zur Zusammenarbeit eingestuft wurde, erhielt einen Mitwirkungspotenzial-Indikator von „1“, während ein Emittent, der zur Zusammenarbeit bereit war, um ein Vorreiter bei der Unterstützung der SDGs zu werden, mit einem Mitwirkungspotenzial-Indikator von „5“ bewertet wurde. Der Sub-Investment-Manager priorisierte Anlagen in Emittenten mit einem Mitwirkungspotenzial-Indikator zwischen „2“ und „5“. Mit dem Mitwirkungspotenzial-Indikator wurden neben den finanziellen Beschränkungen für den Emittenten verschiedene Faktoren berücksichtigt, darunter die Bedeutung der SDGs im Geschäftsbetrieb des Emittenten, die Offenlegungspraktiken des Emittenten und die Beziehung des Sub-Investment-Managers zum Emittenten.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.



Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
k.A.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Strategic Income Fund (das „Portfolio“)

Unternehmenskennung: 549300RBLDK0PHH13M43

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Nein

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „Bezugszeitraum“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO₂-Fußabdrucks, Umweltmanagement, Treibhausgasemissionen („**THG**“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, Gelegenheiten für erneuerbare Energien, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikoübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen in der Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hauseigene Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**NB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektor-kriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteten ESG-Daten erstellt. Ergänzend kommen interne qualitative Analysen hinzu, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistenteam des Portfolio-Analyistenteam genutzt wird. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existierte kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergriff, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühte sich der Sub-Investment-Manager, konstruktiven Dialogen bei Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

| Bezugszeitraum | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | 71 | 1-100 | 48 % |
| Daten von Dritten | 6,0 | 0-10 | |

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet. Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmensemittenten gemessen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und Chancen durch den Klimawandel pro Emission und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit eine Emission durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 8,7 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 20 %, was einem Durchschnitt der vier Kalenderquartalsenden entspricht.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen. Darüber hinaus schloss das Portfolio Emittenten von Unternehmensanleihen aus den Schwellenländern aus, die in der Tabakindustrie tätig und an Kinderarbeit beteiligt waren.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlage des Portfolios).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

| | NB-ESG-Quotient-Rating | Rating der Daten durch externe Anbieter | Kombinierte Abdeckung |
|---------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| Bereich | 1-100 | 0-10 | 0-100 % |
| Bezugszeitraum 2022 | 72 | 5,7 | 66 % |
| Bezugszeitraum 2023 | 71 | 6,0 | 48 % |

Das NB-ESG-Quotient-Rating hat sich im Vergleich zum Vorjahr verschlechtert, und das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich verbessert. Dies ist unter Umständen auf eine Verbesserung bei den einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten gemäß externem Datenanbieter oder auf Differenzen im von dem Anbieter bereitgestellten externen Rating des Emittenten zurückzuführen.

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die kombinierte Abdeckung durch den NB-ESG-Quotienten und das externe Rating verschlechtert. Die ESG-Analyse wird intern durchgeführt, mit Unterstützung durch die Daten externer Anbieter, und nicht ausgelagert. Der Sub-Investment-Manager nimmt auf kontinuierlicher Basis Bewertungen dieser ESG-Merkmale vor. Von Zeit zu Zeit kann es vorkommen, dass einem Emittent zum Zeitpunkt der Anlage für einen kurzen Zeitraum kein NB-ESG-Quotient-Rating zugewiesen wird. Der Sub-Investment-Manager steht in regelmäßigen Abständen mit externen Anbietern von ESG-Daten in Kontakt, um Themen wie die Datenabdeckung zu diskutieren und Optionen zur Behebung von Datenlücken zu prüfen. Die Nutzung mehrerer externer Anbieter von ESG-Daten ermöglicht es dem Sub-Investment-Manager, die Datenabdeckung und die Qualität der Daten der externen Anbieter von ESG-Daten zu bewerten. Darüber hinaus prüft der Sub-Investment-Manager weiterhin neue ESG-Datenprodukte und externe Anbieter von ESG-Daten, um potenzielle Verbesserungen unserer bestehenden ESG-Datenabdeckung zu bewerten.

2. CVaR

| | CVaR | Abdeckung |
|---------------------|---------|-----------|
| Bezugszeitraum 2022 | -10,2 % | 33 % |
| Bezugszeitraum 2023 | -8,7 % | 20 % |

Der durch die CVaR prognostizierte Verlust hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmensemittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

Die CVaR-Abdeckung des Portfolios ist im Vergleich zum Vorjahr zurückgegangen. Zurückzuführen ist dies auf die Handelsaktivität und Datenbeschränkungen. Der CVaR wird nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmensemittenten angewandt und ist stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die es ausreichende und zuverlässige Daten gibt.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

| | Gesamtzahl der Verstöße |
|---------------------|-------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0 |
| Bezugszeitraum 2023 | 0 |

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte in Bezug auf die Nachhaltigkeitsfaktoren die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 1 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für Unternehmensemittenten (die „**PAIs für Unternehmensemittenten**“), und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 2 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für staatliche Emittenten (die „**staatlichen PAIs**“) (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“):

| Teil 1 – PAIs für Unternehmensemittenten | |
|--|--|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgasemissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |
| Teil 2 – staatliche PAIs | |
| <i>Umwelt</i> | PAI 15 - THG-Emissionsintensität |
| <i>Soziales</i> | PAI 16 - Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|----------------------|---|-------------------------|------|
| TREASURY (CPI) NOTE | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 3,0 % | USA |
| UMBS 30YR TBA(REG A) | k.A. | 1,9 % | USA |
| UMBS 30YR TBA(REG A) | k.A. | 1,7 % | USA |
| UMBS 30YR TBA(REG A) | k.A. | 1,6 % | USA |
| TREASURY NOTE | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,5 % | USA |
| UMBS 30YR TBA(REG A) | k.A. | 1,4 % | USA |
| UMBS 30YR TBA(REG A) | k.A. | 1,3 % | USA |
| TREASURY NOTE | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,2 % | USA |
| TREASURY NOTE | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,1 % | USA |
| UMBS 30YR TBA(REG A) | k.A. | 1,0 % | USA |
| UMBS 30YR TBA(REG A) | k.A. | 1,0 % | USA |
| TREASURY NOTE | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,0 % | USA |
| TREASURY NOTE | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,0 % | USA |
| UMBS 30YR TBA(REG A) | k.A. | 1,0 % | USA |
| UMBS 30YR TBA(REG A) | k.A. | 1,0 % | USA |

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.



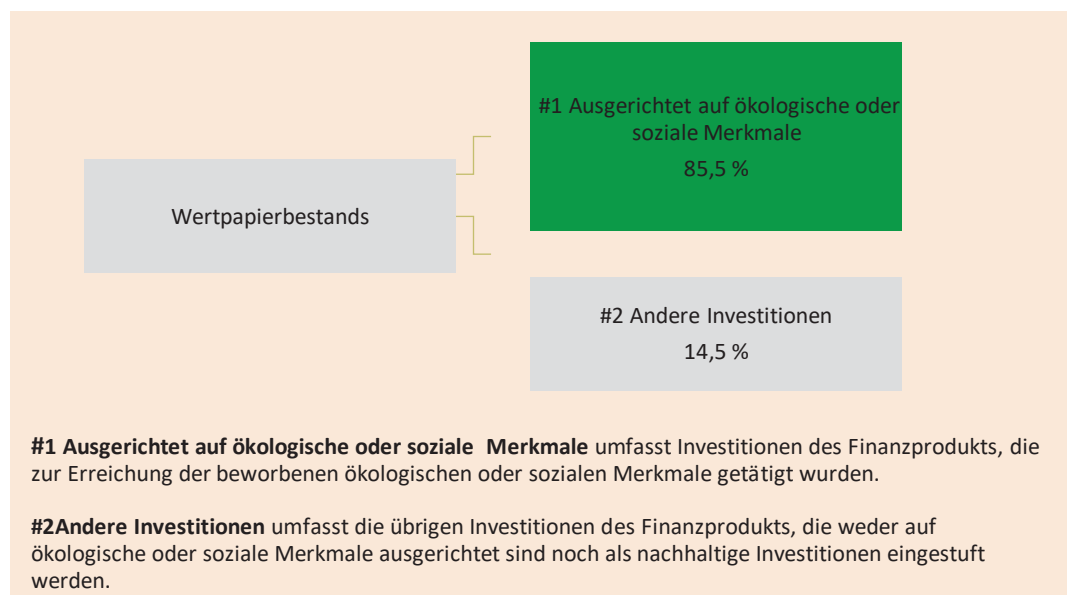
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 60 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 85,5 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 40 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 14,5 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Bildung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalender quartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|--|-------------------------|
| A – Landwirtschaft, Forstwirtschaft und Fischerei | 0,0 % |
| B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden | 1,4 % |
| C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 5,2 % |
| D – Energieversorgung | 1,8 % |
| E – Wasserversorgung, Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen | 0,0 % |
| F – Baugewerbe/Bau | 0,2 % |
| G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 1,3 % |
| H – Verkehr und Lagerei | 2,4 % |
| I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie | 0,2 % |
| J – Information und Kommunikation | 4,2 % |
| K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 15,2 % |
| L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 0,9 % |
| M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen | 0,3 % |
| N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 1,1 % |
| O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 14,1 % |
| P – Erziehung und Unterricht | 0,1 % |
| Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen | 0,5 % |
| R – Kunst, Unterhaltung und Erholung | 0,5 % |
| S – Sonstige Dienstleistungen | 0,1 % |
| U – Exterritoriale Organisationen und Körperschaften | 0,0 % |
| Keine | 50,7 % |

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine 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

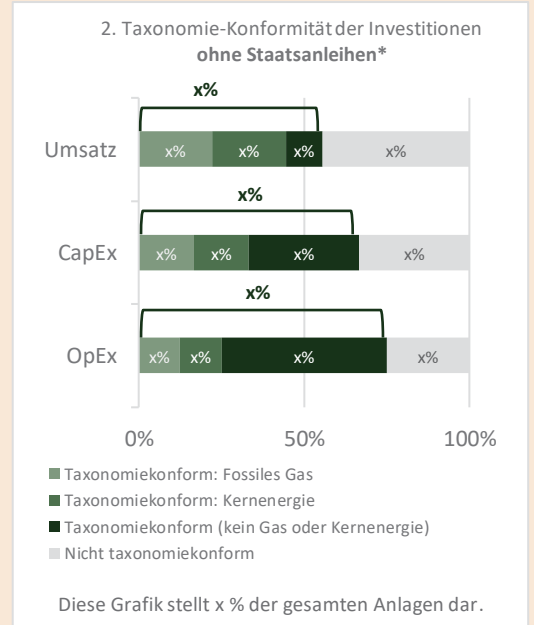
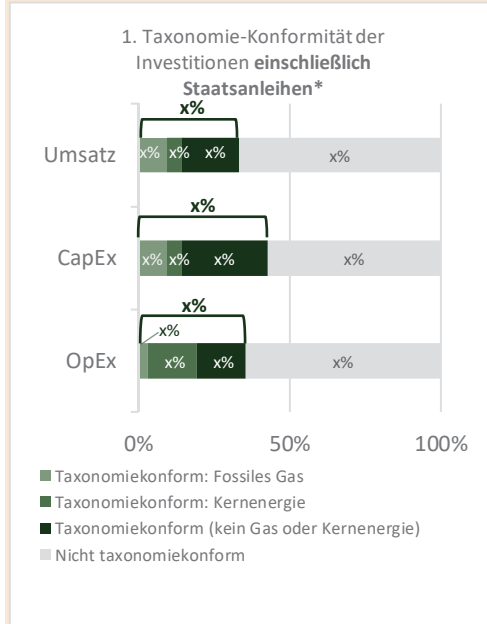
Nein

¹ Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Anlagen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate, Wertpapiere der Kategorie „To be Announced“ [„TBA“] oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert sind, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen einzustufen waren.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittentenanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in seine internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Er strebte danach, konstruktiven Dialogen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Sustainable Asia High Yield Fund (das „Portfolio“)

Unternehmenskennung: 5493005FAT85HZ73DG37

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> Ja | <input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Nein |
|--|---|
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___% <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht 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 63.2 %* an nachhaltigen Investitionen. <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 |
| <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 |

*Weitere Einzelheiten zum Mindestanteil nachhaltiger Investitionen, die ökologische oder soziale Merkmale bewerben, finden Sie unter der Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“.

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „Bezugszeitraum“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für Unternehmensemittenten beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und Landnutzung, Kohlenstoffemissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Wasserstress, Schadstoffemissionen und Abfälle, Finanzierung von Umweltauswirkungen, CO₂-Fußabdruck von Produkten, Umweltpolitik, Umweltmanagementsystem, Programme zur Reduzierung von THG-Emissionen („**THG**“) umweltfreundliche Beschaffungspolitik und Programme für treibhausfreie Luftemissionen.

Im Bestreben, das Portfolio auf ein Netto-Null-Ziel auszurichten, bewarb und bewirbt der Sub-Investment-Manager künftig die Verringerung des CO₂-Fußabdrucks des Portfolios in Bezug auf Scope-1-, Scope-2- und wesentliche Scope-3-Treibhausgasemissionen.¹ Es existiert kein jährliches Reduktionsziel. Stattdessen wird sich auf das Zwischenziel 2030 und das Netto-Null-Ziel 2050 konzentriert.

Das Portfolio erreichte im Bezugszeitraum ein Niveau der reduzierten CO₂-Emissionen, die um mindestens 30 % niedriger war als das des breiteren Anlageuniversum asiatischer Hochzinsanleihen, das durch den J.P. Morgan Asian Credit High Yield Index (der „**Index**“) repräsentiert wird. Die durchschnittliche CO₂-Emissionsintensität wurde auf der Grundlage der CO₂-Emissionsintensität des Portfolios gemessen und berechnet. Sie wurde an jedem der vier Kalenderquartalsenden im Bezugszeitraum ermittelt. Das Portfolio wird aktiv verwaltet und beabsichtigt nicht, den Index abzubilden. Er wird hier zu Zwecken der Reduzierung der CO₂-Emissionsintensität und des ESG-Vergleichs aufgenommen.

Für den Bezugszeitraum erreichte das Portfolio eine höhere ESG-Bewertung als das breitere Universum asiatischer Hochzinsanleihen, das durch den Index repräsentiert wird, basierend auf den ESG-Bewertungen eines etablierten externen Anbieters.

- **Soziale Merkmale:** Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Schutz der Privatsphäre und Datensicherheit, Produktsicherheit und -qualität, Sicherheit von Finanzprodukten, Diskriminierungspolitik, Programme zur Einbindung der Gemeinschaft, Diversitätsprogramme und Menschenrechtspolitik.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

¹Scope-1-Emissionen sind direkte Emissionen aus Quellen, die sich im Besitz des Emittenten befinden oder von ihm kontrolliert werden (z. B. Emissionen, die sich direkt durch die Geschäftsprozesse des Emittenten oder durch Fahrzeuge im Besitz des Emittenten ergeben). Scope-2-Emissionen sind indirekte Emissionen aus der Erzeugung von Strom, Dampf, Wärme und Kälte, die vom Emittenten verbraucht wurden. Scope-3-Emissionen sind alle anderen indirekten Emissionen, die in der Wertschöpfungskette eines Emittenten anfallen (u. a. Emissionen aus den vom Emittenten verbrauchten Produkten oder Dienstleistungen, aus der Entsorgung seiner Abfälle, aus dem Pendelverkehr seiner Mitarbeiter, aus dem Vertrieb und Transport seiner Produkte oder aus seinen Investitionen).

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden.

Der Sub-Investment-Manager schloss Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating aus, es sei denn, es bestand die begründete Erwartung, dass sich das NB-ESG-Quotient-Rating im Laufe der Zeit verbessern würde.

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Bezugszeitraum | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | 56 | 1-100 | 100 % |
| Daten von Dritten | 5,4 | 0-10 | |

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren). Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch

solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischen Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen. Darüber hinaus wurden Emittenten ausgeschlossen, die direkt in Kinderarbeit und die Tabakindustrie involviert waren.

Ab dem 6. Dezember 2023 schloss das Portfolio Emittenten aus dem Anlageuniversum aus, die Brandwaffen unter Verwendung von weißem Phosphor herstellten oder einen Bezug zur Atomwaffenindustrie hatten. Der Sub-Investment-Manager schloss außerdem Wertpapiere von Unternehmen aus, die 5 % oder mehr ihrer Umsätze aus der Herstellung von Material für die Erwachsenenunterhaltung oder der Herstellung konventioneller Waffen erzielt haben.

Ab dem 6. Dezember 2023 investierte das Portfolio nicht in Schuldtitel und Geldmarktinstrumente staatlicher oder zu 100 % in staatlichem Besitz befindlicher Emittenten, bei denen der Sub-Investment-Manager eine schwache ESG-Praxis festgestellt hat, und solche Emittenten wurden aus dem Portfolio ausgeschlossen. Diese Ausschlüsse basierten auf einer Reihe von ESG-Kriterien, darunter:

- Staatliche Emittenten, die auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten im untersten Dezil rangierten und bei denen keine Aussicht auf kurzfristige Verbesserungen bestanden; oder
- staatliche Emittenten, die aufgrund von ESG-Erwägungen aus dem J.P. Morgan ESG EMBI Global Diversified Index ausgeschlossen wurden; oder
- Staatliche Emittenten, deren führende Vertreter vom UN-Sicherheitsrat aufgrund von Menschenrechtsverletzungen mit Sanktionen belegt wurden; oder
- staatliche Emittenten, bei denen eine hohe und steigende Emissionsintensität bezogen auf die Treibhausgase festgestellt wurde; oder
- staatliche Emittenten, die den vom Global Forum on Transparency and Exchange of Information for Tax Purposes der OECD aufgestellten Standard nicht einhielten, oder
- staatliche Emittenten, die von der Financial Task Force („**FATF**“) als Hochrisikoland eingestuft wurden

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. Der NB-ESG-Quotient

| | NB-ESG-Quotient-Rating | Rating der Daten durch externe Anbieter | Kombinierte Abdeckung |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| Bereich | 1-100 | 0-10 | 0-100 % |
| Bezugszeitraum 2022 | 55 | 4,2 | 95 % |
| Bezugszeitraum 2023 | 56 | 5,4 | 100 % |

Die Bewertung des NB-ESG-Quotienten hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

Das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen sowie auf potenzielle Änderungen oder Unterschiede im externen Emittenten-Rating.

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die kombinierte Abdeckung durch den NB-ESG-Quotienten und das Rating externer Anbieter verbessert. Dies ist auf eine verbesserte Datenabdeckung bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

2. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

| | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|--------------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0 |
| Bezugszeitraum 2023 | 0 |

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckt sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Investition zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Investition eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat (wie nachstehend erläutert) und (iii) eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die Unternehmensführung eines Emittenten, um festzustellen, ob der Emittent einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die wirtschaftlichen Tätigkeiten eines Emittenten auf ökologische oder soziale Merkmalen ausgerichtet waren.

Der Sub-Investment-Manager überprüfte die Emittenten auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Emittenten diese Prüfung bestanden haben, hat der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag des Emittenten zur Wirtschaft gemessen.

Bei Unternehmensemittenten hat der Sub-Investment-Manager dies auf zwei Arten erfasst:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen („SDGs“).

Die Berücksichtigung Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs, nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers, war durch die Verfügbarkeit von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Der Sub-Investment-Manager wandte seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigten. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „PAIs“):

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

| PAIs | |
|-------------------------------|--|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgasemissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind PAI 5 - Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren |
| <i>Biodiversität</i> | PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken |
| <i>Wasser</i> | PAI 8 - Emissionen in Wasser |
| <i>Abfall</i> | PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle |

| | |
|-----------------------------------|--|
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | <p>PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen</p> <p>PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen</p> <p>PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle</p> <p>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen</p> <p>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)</p> |
|-----------------------------------|--|

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Sub-Investment-Manager hat auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Emittenten, die quantitative und qualitative Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI festgelegt wurden, unterschreiten;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Emittenten, wenn sie unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „*Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?*“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.
2. Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| PAIs auf Produktebene | |
|-----------------------------------|---|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgas-emissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbar Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|--|--|-------------------------|-------------|
| GREENKO POWER II LIMITED RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 4,0 % | Indien |
| SANDS CHINA LTD | R – Kunst, Unterhaltung und Erholung | 3,5 % | Macau |
| STANDARD CHARTERED PLC RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 2,7 % | Hongkong |
| GLOBE TELECOM INC RegS | J – Information und Kommunikation | 2,4 % | Philippinen |
| MELCO RESORTS FINANCE LTD RegS | R – Kunst, Unterhaltung und Erholung | 2,4 % | Macau |
| STUDIO CITY FINANCE LTD RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 2,3 % | Macau |
| MELCO RESORTS FINANCE LTD RegS | R – Kunst, Unterhaltung und Erholung | 2,3 % | Macau |
| CONTINUUM ENERGY LEVANTER PTE LTD RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 2,1 % | Indien |
| NETWORK I2I LTD RegS | J – Information und Kommunikation | 2,1 % | Indien |
| WYNN MACAU LTD RegS | I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie | 1,9 % | Macau |
| RENEW POWER PVT LTD RegS | D – Energieversorgung | 1,8 % | Indien |
| JSW HYDRO ENERGY LTD RegS | D – Energieversorgung | 1,8 % | Indien |
| ADANI GREEN ENERGY UP LTD RegS | D – Energieversorgung | 1,7 % | Indien |

| | | | |
|--|---|-------|------------|
| STAR ENERGY GEOTHERMAL WAYANG WIND RegS | D – Energieversorgung | 1,7 % | Indonesien |
| SRI LANKA DEMOCRATIC SOCIALIST RE RegS | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,7 % | Sri Lanka |

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.



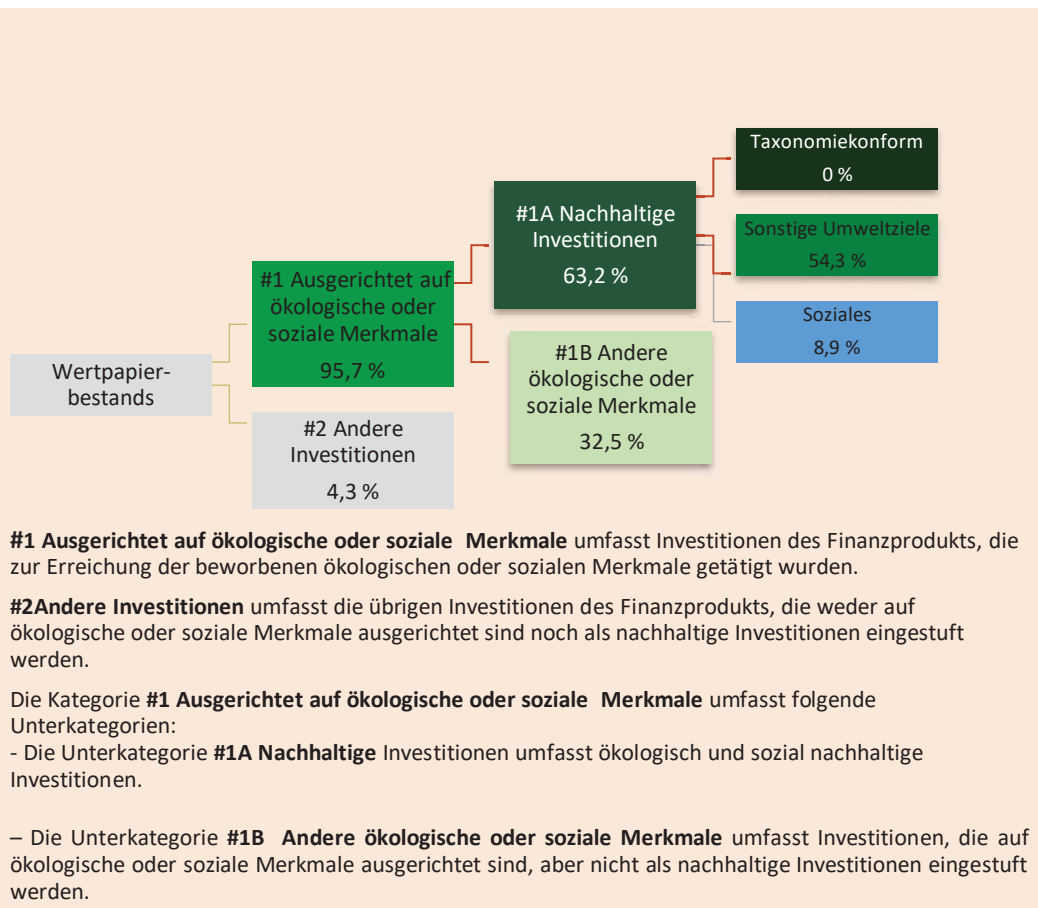
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 95,7 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio verpflichtete sich, mindestens 50 % nachhaltige Investitionen zu halten. Während des Bezugszeitraums 2023 hielt das Portfolio 63,2 % an nachhaltigen Investitionen.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 4,3 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|---|-------------------------|
| C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 4,9 % |
| D – Energieversorgung | 10,2 % |
| F – Baugewerbe/Bau | 5,5 % |
| G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 0,9 % |
| I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie | 5,0 % |
| J – Information und Kommunikation | 4,7 % |
| K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 50,9 % |
| M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen | 1,4 % |
| O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 6,3 % |
| R – Kunst, Unterhaltung und Erholung | 9,2 % |
| Keine | 1,0 % |

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

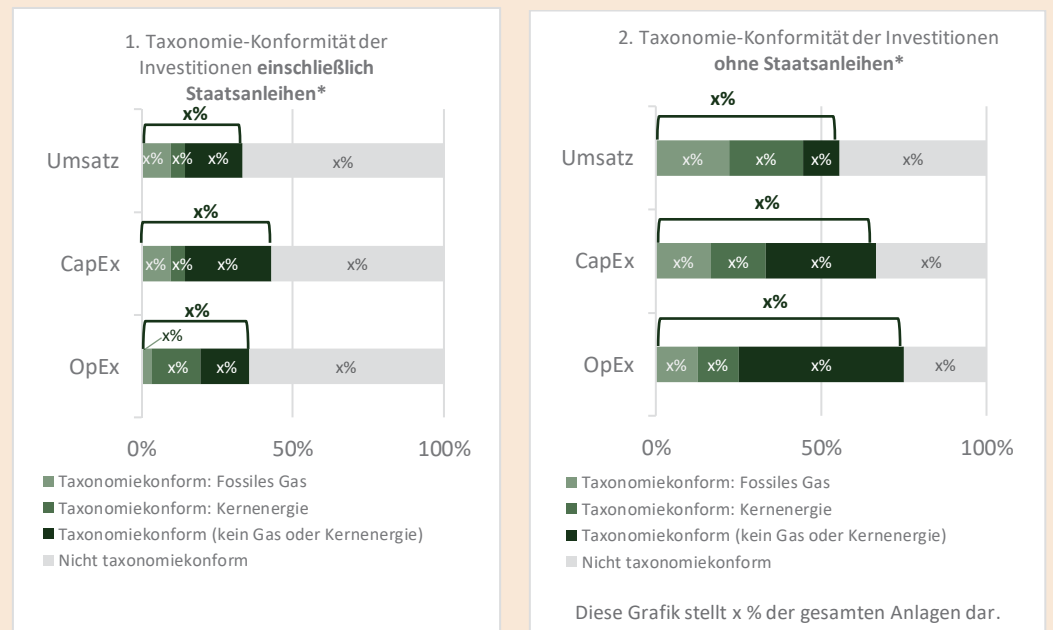
● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert²?**

- Ja:
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

² Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Das Portfolio hielt 54,3 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, das nicht mit der EU-Taxonomie konform ist.



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?

Das Portfolio hielt 8,9 % an sozial nachhaltigen Investitionen.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittentenanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine wichtige Komponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

k.A.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

k.A.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

k.A.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Sustainable Emerging Market Corporate Debt Fund (das „Portfolio“)

Unternehmenskennung: 549300GFVJSXLRLRQ502

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Nein

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 51,6 %* an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

*Weitere Einzelheiten zum Mindestanteil nachhaltiger Investitionen, die ökologische oder soziale Merkmale bewerben, finden Sie unter der Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“.

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „Bezugszeitraum“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und Landnutzung, Kohlenstoffemissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Wasserstress, Schadstoffemissionen und Abfälle, Finanzierung von Umweltauswirkungen, CO₂-Fußabdruck von Produkten, Umweltpolitik, Umweltmanagementsystem, Programme zur Reduzierung von THG-Emissionen („THG“) umweltfreundliche Beschaffungspolitik und Programme für treibhausfreie Luftemissionen.

In dem Bestreben, das Portfolio auf ein Netto-Null-Ziel auszurichten, bewarben und bewerben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Verringerung des CO₂-Fußabdrucks des Portfolios in Bezug auf Scope-1-, Scope-2- und wesentliche Scope-3-THG-Emissionen.¹ Es existiert kein jährliches Reduktionsziel. Stattdessen wird sich auf das Zwischenziel 2030 und das Netto-Null-Ziel 2050 konzentriert.

Das Portfolio erreichte eine CO₂-Emissionsintensität, die mindestens 30 % unter derjenigen des breiteren Anlageuniversums für Unternehmensanleihen aus Schwellenländern lag, das durch den Index J.P. Morgan CEMBI Diversified (USD) Index (der „Index“) repräsentiert wird. Davon ausgenommen sind Wertpapiere, die von Nicht-Unternehmensemittenten begeben wurden, zu denen öffentliche oder quasi-öffentliche Emittenten (d. h. staatliche Emittenten) sowie Barmittel oder Barmitteläquivalente gehören („ausgeschlossene Wertpapiere“). Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet. Das Portfolio wurde aktiv verwaltet und bildete nicht den Index ab. Er wurde hier zu Vergleichszwecken für die Reduzierung der CO₂-Emissionsintensität und von aufgenommen.

Für den Bezugszeitraum erreichte das Portfolio eine höhere ESG-Bewertung (wie von einem dritten Datenanbieter zugewiesen) als das breitere, durch den Index repräsentierte Universum der Unternehmensanleihen aus Schwellenländern.

- **Soziale Merkmale:** Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Schutz der Privatsphäre und Datensicherheit, Produktsicherheit und -qualität, Sicherheit von Finanzprodukten, Diskriminierungspolitik, Programme zur Einbindung der Gemeinschaft, Diversitätsprogramme und Menschenrechtspolitik.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses haben der Manager und der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „NB- ESG-Quotient“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

¹Scope-1-Emissionen sind direkte Emissionen aus Quellen, die sich im Besitz des Emittenten befinden oder von ihm kontrolliert werden (z. B. Emissionen, die sich direkt durch die Geschäftsprozesse des Emittenten oder durch Fahrzeuge im Besitz des Emittenten ergaben). Scope-2-Emissionen sind indirekte Emissionen aus der Erzeugung von Strom, Dampf, Wärme und Kälte, die vom Emittenten verbraucht wurden. Scope-3-Emissionen sind alle anderen indirekten Emissionen, die in der Wertschöpfungskette eines Emittenten anfallen (u. a. Emissionen aus den vom Emittenten verbrauchten Produkten oder Dienstleistungen, aus der Entsorgung seiner Abfälle, aus dem Pendelverkehr seiner Mitarbeiter, aus dem Vertrieb und Transport seiner Produkte oder aus seinen Investitionen).

Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergriffen hat, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühten sich der Manager und der Sub-Investment-Manager einem konstruktiven Dialog mit Emittenten mit einer schlechten Bewertung des NB-ESG-Quotienten Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Bezugszeitraum | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | 60 | 1-100 | 100 % |
| Daten von Dritten | 5,6 | 0-10 | |

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. ESG-Ausschlusspolitik::

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy und die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren). Das Portfolio baut sein Engagement in Kraftwerkskohle schrittweise ab und verbietet Investitionen in Wertpapiere von Emittenten, die mehr als 10 % ihrer Einnahmen aus dem Abbau von Kraftwerkskohle erzielten oder die neue Kohlekraftwerke ausbauten (wie durch interne Prüfungen festgestellt). Das Portfolio verbot außerdem Investitionen in Emittenten aus der Kraftwerksindustrie, die mehr als 95 % ihrer installierten Kraftwerkskapazitäten aus Kraftwerkskohle beziehen, die in neue Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle expandieren oder deren Investitionsbudgets für Expansionszwecke keine Mindestschwelle für Investitionen in Nicht-Kohle enthalten (wie durch interne Prüfungen festgestellt). Ab dem 6. Dezember 2023 schloss das Portfolio Unternehmen aus dem Anlageuniversum aus, die Brandwaffen unter Verwendung von weißem Phosphor herstellen oder einen Bezug zur Atomwaffenindustrie hatten. Das Portfolio hat Wertpapiere von Unternehmen ausgeschlossen, die 5 % oder mehr ihrer Umsätze aus der Herstellung von Material für die Erwachsenenunterhaltung erzielt haben. Zudem investierte das Portfolio nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem

unternehmerischen Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen. Darüber hinaus schloss das Portfolio Wertpapiere von Emittenten aus, die 5 % oder mehr ihrer Umsätze aus der Herstellung von Tabakerzeugnissen oder der Herstellung konventioneller Waffen erzielten. Emittenten, die an direkter Kinderarbeit beteiligt waren, und Emittenten, die mehr als 10 % der Umsätze aus der Ölsandgewinnung erzielten, wurden ebenfalls ausgeschlossen.

Ab dem 6. Dezember 2023 investierte das Portfolio nicht in Schuldtitel und Geldmarktinstrumente staatlicher oder zu 100 % in staatlichem Besitz befindlicher Emittenten, bei denen der Manager und der Sub-Investment-Manager eine schwache ESG-Praxis festgestellt haben, und solche Emittenten wurden aus dem Portfolio ausgeschlossen. Diese Ausschlüsse basierten auf einer Reihe von ESG-Kriterien, darunter:

- Staatliche Emittenten, die auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten im untersten Dezil rangierten und bei denen keine Aussicht auf kurzfristige Verbesserungen bestanden; oder
- Staatliche Emittenten, die aufgrund von ESG-Erwägungen aus dem J.P. Morgan ESG EMBI Global Diversified Index ausgeschlossen wurden; oder
- Staatliche Emittenten, deren führende Vertreter vom UN-Sicherheitsrat aufgrund von Menschenrechtsverletzungen mit Sanktionen belegt wurden; oder
- Staatliche Emittenten, bei denen eine hohe und steigende Emissionsintensität bezogen auf die Treibhausgase festgestellt wurde; oder
- Staatliche Emittenten, die den vom Global Forum on Transparency and Exchange of Information for Tax Purposes der OECD aufgestellten Standard nicht einhielten, oder staatliche Emittenten, die von der Financial Action Task Force („**FATF**“) als Hochrisikoland eingestuft wurden.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstießen. Wo möglich haben der Manager und der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise ihrer Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager erörterten und diskutierten die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund ihres eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. Der NB-ESG-Quotient

| | NB-ESG-Quotient-Rating | Rating der Daten durch externe Anbieter | Kombinierte Abdeckung |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| Bereich | 1-100 | 0-10 | 0-100 % |
| Bezugszeitraum 2022 | 59 | 5,5 | 98 % |

| | | | |
|----------------------------|----|-----|-------|
| Bezugszeitraum 2023 | 60 | 5,6 | 100 % |
|----------------------------|----|-----|-------|

Die Bewertung des NB-ESG-Quotienten hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

Das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen sowie auf potenzielle Änderungen oder Unterschiede im externen Emittenten-Rating.

2. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

| | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|--------------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0 |
| Bezugszeitraum 2023 | 0 |

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckt sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Investition zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Investition eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat (wie nachstehend erläutert) und (iii) eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die Unternehmensführung eines Emittenten, um festzustellen, ob der Emittent einer derartige Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griffen der Manager und der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die wirtschaftlichen Tätigkeiten eines Emittenten auf ökologische oder soziale Merkmalen ausgerichtet waren.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager überprüften die Emittenten auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Emittenten diese Prüfung bestanden haben, haben der Manager und der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag des Emittenten zur Wirtschaft gemessen.

Bei Unternehmensemittenten haben der Manager und der Sub-Investment-Manager dies auf zwei Arten erfasst:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen („SDGs“).

Die Berücksichtigung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs, nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers, war durch die Verfügbarkeit von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griffen der Manager und der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Stellvertreterdaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltige Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager wandten ihren Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigen. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachteten der Manager und der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „**PAIs**“):

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

| PAIs | |
|-----------------------------------|---|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgas-emissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind PAI 5 - Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren |
| <i>Biodiversität</i> | PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken |
| <i>Wasser</i> | PAI 8 - Emissionen in Wasser |
| <i>Abfall</i> | PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager investierten nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

— — — *Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Manager und den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine

erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Emittenten, die quantitative und qualitative Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden, unterschreiten;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Emittenten, wenn sie unter die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager investierten nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager und den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

- I. Wie oben unter „*Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?*“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.
- II. Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| PAIs auf Produktebene | |
|-----------------------------------|--|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgasemissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager und den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und

- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|---|---|-------------------------|-------------------------|
| ROMANIA (REPUBLIC OF) MTN RegS | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,4 % | Rumänien |
| COTE D IVOIRE (REPUBLIC OF) RegS | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,2 % | Elfenbeinküste |
| SANDS CHINA LTD | R – Kunst, Unterhaltung und Erholung | 1,0 % | Macau |
| WYNN MACAU LTD RegS | I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie | 0,9 % | Macau |
| TSMC ARIZONA CORP | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 0,9 % | Taiwan (Republik China) |
| TSMC GLOBAL LTD RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 0,9 % | Taiwan (Republik China) |
| MELCO RESORTS FINANCE LTD RegS | R – Kunst, Unterhaltung und Erholung | 0,8 % | Macau |
| KOSMOS ENERGY LTD RegS | B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden | 0,7 % | Ghana |
| BOC AVIATION LTD MTN RegS | N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 0,7 % | Singapur |
| ECOPETROL SA | B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden | 0,6 % | Kolumbien |
| BANGKOK BANK PUBLIC CO LTD (HONG K MTN RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 0,6 % | Thailand |
| THAI OIL TREASURY CENTER CO LTD MTN RegS | M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen | 0,6 % | Thailand |
| CENCOSUD SA RegS | G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 0,6 % | Chile |
| TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO MTN RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 0,6 % | Türkei |
| HUARONG FINANCE II CO LTD MTN RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 0,6 % | China |

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.



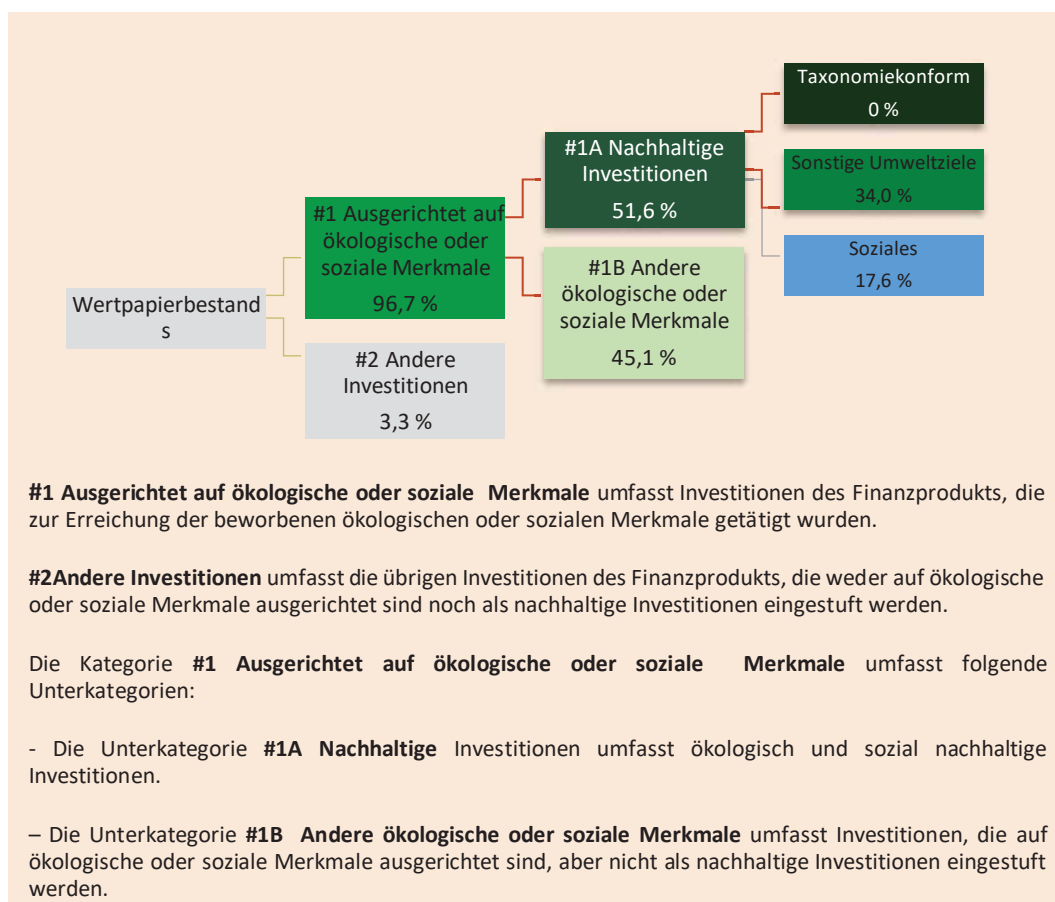
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 96,7 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio verpflichtete sich, mindestens 50 % nachhaltige Investitionen zu halten. Während des Bezugszeitraums 2023 hielt das Portfolio 51,6 % an nachhaltigen Investitionen.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 3,3 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berechneten den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager und der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatten. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|--|-------------------------|
| B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden | 10,1 % |
| C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 13,2 % |
| D – Energieversorgung | 2,7 % |
| F – Baugewerbe/Bau | 0,9 % |
| G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 1,3 % |
| H - Verkehr und Lagerei | 1,8 % |
| I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie | 1,4 % |

| | |
|---|--------|
| J – Information und Kommunikation | 4,6 % |
| K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 51,8 % |
| L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 0,6 % |
| M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen | 0,7 % |
| N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 1,6 % |
| O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 5,7 % |
| R – Kunst, Unterhaltung und Erholung | 2,9 % |
| U – Exterritoriale Organisationen und Körperschaften | 0,2 % |
| Keine | 0,4 % |

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: *Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.*



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine 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 investiert²?**

Ja: In fossiles Gas In Kernenergie

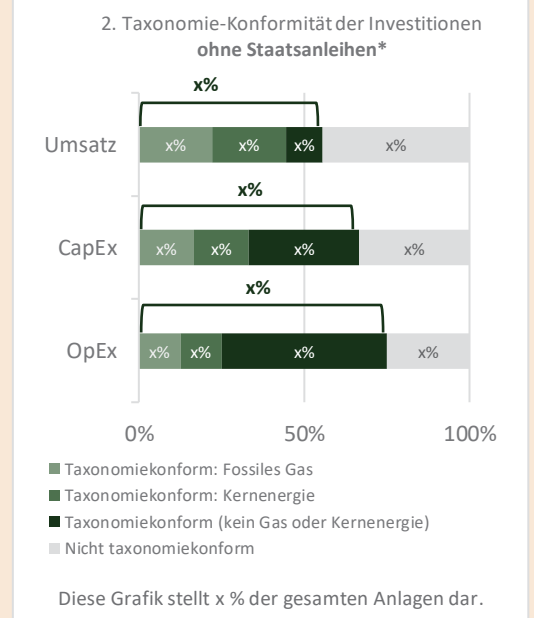
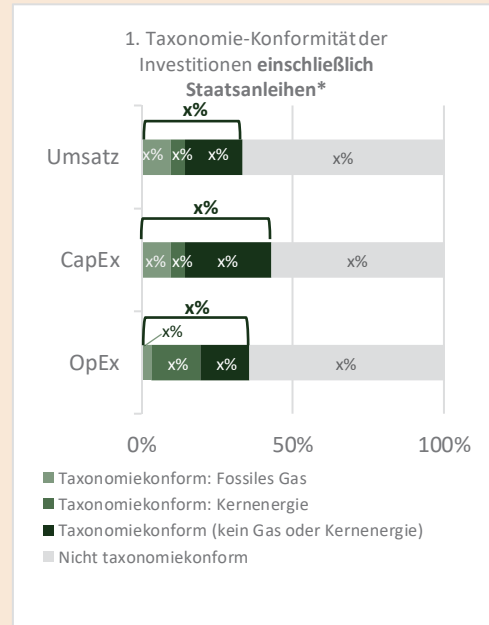
Nein

² Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager können bestätigen, dass das Portfolio in Investitionen investiert hat, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager und der Sub-Investment-Manager werden das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessert.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Das Portfolio hielt 34,0 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, das nicht mit der EU-Taxonomie konform ist.



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?

Das Portfolio hielt 17,6 % an sozial nachhaltigen Investitionen.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager und der Sub-Investment-Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachteten, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen, verhinderten und sie sicherstellen, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager wendeten bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager verstehen unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Managers und des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers und des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager und vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager engagierten sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager betrachteten diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil ihres Anlageprozesses. Die Fortschritte bei der Einbindung wurden vom Manager und dem Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 9, Absätze 1 bis 4a, der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten.

Name des Produkts: Neuberger Berman Sustainable Emerging Market Debt – Hard Currency Fund (das „Portfolio“)

Unternehmenskennung: 549300OWRIKGBWGY0X93

Nachhaltiges Investitionsziel

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: **56,9 %**

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: **36,9 %**

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben**, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „Bezugszeitraum“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.



Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?

Das Portfolio investierte in Wertpapiere von Emittenten, die zu ökologischen und sozialen Zielen beitragen. Die Emittenten wurden gegenüber dem nachhaltigen Anlageziel anhand der nachstehend aufgeführten Parameter bewertet.

Ökologische Ziele

Der Sub-Investment-Manager hat gezielt in Emittenten investiert, die nachweislich bessere einkommensbereinigte Fortschritte bei der Anpassung und der Eindämmung des Klimawandels, der Reduzierung von Treibhausgasemissionen („THG“), der Vitalität von Ökosystemen und der Ausrichtung auf das Netto-Null-Ziel gemacht haben.

Ziele staatlicher Emittenten:

Länder, die sich im obersten 25. Perzentil befinden oder im nächsten 25. Perzentil mit sich verbessernden Merkmalen in Bezug auf den Indikator des staatlichen Klimaübergangsrisiko (dieser Indikator ist Eigentum des Sub-Investment-Managers und kombiniert Daten, die sich auf die Minderung des Klimarisikos, die Anpassung an den Klimawandel, die Vitalität von Ökosystemen, die THG-Emissionen und die Anpassung an das Netto-Null-Ziel konzentrieren), wurden als in Einklang mit dem Umweltziel erachtet.

Die Netto-Null-Verpflichtungen und -Ziele wurden in der Erwartung festgelegt, dass die Regierungen ihre eigenen Verpflichtungen einhalten, um sicherzustellen, dass die Ziele des Pariser Abkommens erreicht werden, einschließlich erhöhter Ambitionen ihrer national festgelegten Beiträge (Nationally Determined Contributions, „NDCs“).

Ziele unternehmerischer Emittenten:

Der Sub-Investment-Manager beabsichtigt, den CO₂-Fußabdruck des Portfolios für Wertpapiere von Unternehmen in Bezug auf Scope-1-, Scope-2- und wesentliche Scope-3-THG-Emissionen zu reduzieren, was einer Verringerung um 50 % bis 2030 im Vergleich zu einem als Basiswert angenommenen Jahr (2019) und einen anschließenden Rückgang auf Null netto bis 2050 entspricht. Das Basisjahr 2019 kann neu berechnet werden, wenn sich die Datenqualität und die Offenlegung im Laufe der Zeit verbessern, insbesondere in Bezug auf die Scope-3-Emissionen.¹ Es existiert kein jährliches Reduktionsziel. Stattdessen wird sich auf den Meilenstein 2030 und das Netto-Null-Ziel 2050 konzentriert.

Soziale Ziele

Der Sub-Investment-Manager zielte auf Investitionen in Emittenten ab, die bessere einkommensbereinigte Fortschritte bei der Erreichung der UN-Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDGs“), mit einem Schwerpunkt auf den Bereichen öffentliche Gesundheit und Bildung, nachweisen konnten.

Länder, die sich im obersten 25. Perzentil befinden oder im nächsten 25. Perzentil mit sich verbessernden Merkmalen in Bezug auf den Indikator für staatliche Nachhaltigkeit (dieser Indikator ist Eigentum des Sub-Investment-Managers und kombiniert Daten, die sich auf Lebenserwartung, Zugang zu Impfungen und medizinischem Fachpersonal, Sekundarschulbildung und eine geringere Einkommensgleichheit), wurden als in Einklang mit dem sozialen Ziel erachtet.

Das Portfolio hat sein nachhaltiges Anlageziel erreicht. Die Performance bzgl. des nachhaltigen Anlageziels wurde anhand der Nachhaltigkeitsindikatoren gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

¹Scope-1-Emissionen sind direkte Emissionen aus Quellen, die sich im Besitz des Emittenten befinden oder von ihm kontrolliert werden (z. B. Emissionen, die sich direkt durch die Geschäftsprozesse des Emittenten oder durch Fahrzeuge im Besitz des Emittenten ergeben). Scope-2-Emissionen sind indirekte Emissionen aus der Erzeugung von Strom, Dampf, Wärme und Kälte, die vom Emittenten verbraucht wurden. Scope-3-Emissionen sind alle anderen indirekten Emissionen, die in der Wertschöpfungskette eines Emittenten anfallen (u. a. Emissionen aus den vom Emittenten verbrauchten Produkten oder Dienstleistungen, aus der Entsorgung seiner Abfälle, aus dem Pendelverkehr seiner Mitarbeiter, aus dem Vertrieb und Transport seiner Produkte oder aus seinen Investitionen).

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die nachhaltigen Ziele dieses Finanzprodukts erreicht werden.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die Erreichung der nachhaltigen Anlageziele des Portfolios zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

i. Berichte und Bewertungen von unabhängigen Dritten:

Der Sub-Investment-Manager nutzte die folgenden Berichte, Indizes und Bewertungen von Dritten, um die Fortschritte des Portfolios bei der Erreichung seiner nachhaltigen Anlageziele für Staaten zu messen:

Fortschritte im Hinblick auf die UN-Ziele für nachhaltige Entwicklung mit einem Schwerpunkt auf die Anpassung an den Klimawandel und den Klimaschutz:

- Notre Dame Global Adaptation Initiative Country Index („**ND-GAIN**“)

Der Sub-Investment-Manager verwendete den ND-GAIN-Index, um die Anfälligkeit eines Landes für den Klimawandel und die Klimaübergangsrisiken zu messen und zu bewerten.

Der Sub-Investment-Manager konzentrierte sich bei seiner Bewertung auf die einkommensbereinigte Anpassung an den Klimawandel.

- THG-Emissionen von Staaten:

Der Sub-Investment-Manager verfolgte die territorialen THG-Emissionen von Staaten, definiert als Tonnen CO₂-Emissionen des um die Kaufkraft („**PPP**“) bereinigten BIP (territoriale Produktionsemissionen) oder pro Kopf (territoriale Konsumemissionen). Emittenten mit der höchsten territorialen Produktionsemissionen – definiert als oberstes Quartil und zunehmend – wurden aus dem Portfolio ausgeschlossen.

- Environmental Performance Index

Der Sub-Investment Manager verfolgte einkommensbereinigte Daten zur Vitalität von Ökosystemen aus dem Environmental Performance Index, einem gemeinsamen Projekt des Yale Center for Environmental Law & Policy und des Center for International Earth Science Information Network („**CIESIN**“) am Earth Institute der Columbia University. Dieser Indikator erfasste, wie gut die Länder Ökosysteme und die von ihnen erbrachten Leistungen erhalten, schützen und verbessern. Er besteht aus sechs Emissionskategorien: Biodiversität und Lebensräume, Ökosystemdienstleistungen, Fischereien, saurer Regen, Landwirtschaft und Wasserressourcen.

- Anpassung an das Netto-Null-Ziel – GermanWatch's Climate Change Performance Index („**CCPI**“) und Climate Action Tracker

Der Sub-Investment-Manager verfolgte die Anpassung an das Netto-Null-Ziel von Ländern, die Staatsanleihen begeben gemäß dem CCPI und dem vom Climate Action Tracker gemessenen nationalen und globalen Bemühungen zur Eindämmung der globalen Erwärmung. Dies ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, Länder anzuvisieren, die sich bis 2050 oder früher zu Netto-Null-Emissionen verpflichtet haben.

Fortschritte bei den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung, mit Schwerpunkt auf der öffentlichen Gesundheit, der Sekundarschulbildung und der Überwindung von Einkommensungleichheiten:

- Sustainable Development Report Index

Der Sub-Investment-Manager nutzte die Bertelsmann Stiftung und den Sustainable Development Solutions Network Sustainable Development Report Index, um die Leistung von Ländern bzgl. der SDGs zu bewerten. Dies ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, gezielt in Emittenten zu investieren, die bessere Fortschritte bei der Verwirklichung der SDGs demonstrierten. Länder, welche die ökologischen oder sozialen Ziele erfüllen, müssen ferner im obersten 75. Perzentil des Sustainable Development Report Index platziert sein, um als nachhaltig zu gelten.

- UNDP Human Development Index

Der Sub-Investment-Manager nutzte den UNDP-Index für menschliche Entwicklung, um auf einkommensbereinigter Basis die Errungenschaften in den Schlüsselbereichen Lebenserwartung, Bildung und Einkommensgleichheit weltweit zu messen. Dies ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, gezielt in Emittenten zu investieren, die bessere Fortschritte für die menschliche Entwicklung demonstrierten.

- Weltgesundheitsorganisation (WHO) – Das Globale Gesundheitsobservatorium

Der Sub-Investment-Manager setzte einkommensbereinigte Daten des Globalen Gesundheitsobservatoriums über die Durchimpfungsrate (Diphtherie-Tetanus-Toxoid) und Keuchhusten („DTP3“) bei Einjährigen sowie die Zahl der Ärzte pro Kopf der Bevölkerung ein.

Top-Performer oder Top-Improver im Portfolio

Die oben aufgeführten Berichte und Bewertungen unabhängiger Dritter wurden zusammengefasst, um „Top-Performers“ (Länder im obersten 25. Perzentil, die mit den ökologischen und/oder sozialen Zielen des Portfolios übereinstimmen) oder „Top-Improvers“ (Länder im nächsthöheren 25. Perzentil, die sich verbessern und an die staatlichen ökologischen und/oder sozialen Zielen des Portfolios angepasst waren und weiterhin anpassen) zu identifizieren.

Nur staatliche Emittenten aus Schwellenländern, die den ökologischen und/oder sozialen Ziele des Portfolios entsprachen und als Top-Performer oder Top-Improver eingestuft wurden, wurden vom Portfolio gehalten. Die Einstufung von Ländern als Top-Performer oder Top-Improver ist ein Hinweis darauf, dass das Portfolio seine Umwelt- und sozialen Ziele erfüllt.

ii. ESG-Ausschlüsse:

Zur Sicherstellung, dass die nachhaltigen Anlageziele des Portfolios erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy oder die Neuberger Berman Enhanced Sustainable Exclusion Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren).

Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Ab dem 6. Dezember 2023 schloss das Portfolio Unternehmen aus dem Anlageuniversum aus, die Brandwaffen unter Verwendung von weißem Phosphor herstellten oder einen Bezug zur Atomwaffenindustrie hatten. Das Portfolio hat ferner Wertpapiere von Unternehmen ausgeschlossen, die 5 % oder mehr ihrer Umsätze aus der Herstellung von Material für die Erwachsenenunterhaltung oder der Herstellung konventioneller Waffen erzielt haben.

Das Portfolio investierte nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen werden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Außerdem schoss der Sub-Investment-Manager Wertpapiere von Unternehmensemittenten aus dem Anlageuniversum aus, die hinsichtlich des NB-ESG-Quotienten² am schlechtesten bewertet wurden.

Darüber hinaus schloss der Sub-Investment-Manager staatliche Emittenten aus, deren Menschenrechtslage sich verschlechtert hat und deren führende Vertreter vom UN-Sicherheitsrat wegen Menschenrechtsverletzungen sanktioniert wurden, oder andere staatliche Emittenten, deren THG-Intensität als hoch erachtet wird und zunimmt, oder staatliche Emittenten, die den vom Global Forum on Transparency and Exchange of Information for Tax Purposes der OECD aufgestellten Standard nicht eingehalten haben, oder staatliche Emittenten, die von der Financial Action Task Force („**FATF**“) als Hochrisikoland eingestuft wurden.

²Der NB- ESG-Quotient ist ein hausinternes ESG-Ratingsystem von NB, das auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten basiert und ein ESG-Gesamtrating für Emittenten erstellt, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Mindestens 20 % des Anlageuniversums wurden aus diesen Gründen ausgeschlossen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

i. Berichte und Bewertungen von unabhängigen Dritten

Im Bezugszeitraum kam es zu den folgenden bemerkenswerten Änderungen gegenüber dem vorherigen Bezugszeitraum:

- Zwei weitere Länder wurden dank Fortschritten bei der Netto-Null-Ausrichtung als ökologisch nachhaltig eingestuft;
- drei weitere Länder wurden dank Fortschritten in Bezug auf die einkommensbereinigte Anpassung an den Klimawandel und die Einführung der Kennzahl zur wirtschaftlichen Vitalität als ökologisch nachhaltig eingestuft;
- vier Länder wurden aufgrund einer schwachen einkommensbereinigten Vitalität von Ökosystemen nicht mehr länger als ökologisch nachhaltig eingestuft;
- ein Land wurde aufgrund einer Verschlechterung bei der einkommensbereinigten Anpassung an den Klimawandel und der THG-Emissionsintensität nicht mehr länger als ökologisch nachhaltig eingestuft;
- zwei weitere Länder wurden dank Einkommensanpassung und neuer Kennzahlen zur Gesundheit und Einkommensungleichheit als sozial nachhaltig eingestuft;
- ein weiteres Land wurde dank Einkommensanpassung und neuer Kennzahlen zur Gesundheit als sozial nachhaltig eingestuft;
- ein weiteres Land wurde dank einer niedrigeren THG-Emissionsintensität als sozial nachhaltig eingestuft;
- zwei Länder wurden aufgrund von Einkommensanpassung und neuer Kennzahlen zur Gesundheit und Einkommensungleichheit nicht mehr länger als sozial nachhaltig eingestuft;
- ein Land wurde aufgrund neuer Kennzahlen zur Gesundheit und Einkommensungleichheit nicht mehr länger als sozial nachhaltig eingestuft;
- ein Land wurde aufgrund der Kennzahl für die Einkommensungleichheit nicht mehr länger als sozial nachhaltig eingestuft; und
- zwei weitere Länder wurden aufgrund von hohen und sich verschlechternden THG-Emissionen nicht mehr länger als ökologisch oder sozial nachhaltig eingestuft.

ii. ESG-Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

| | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|--------------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0 |
| Bezugszeitraum 2023 | 0 |

Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?

Der Sub-Investment-Manager wandte seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigten. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachen würde, betrachtete der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Sub-Investment-Manager trug bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlageziele waren, den folgenden Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen Rechnung. Bei staatlichen Emittenten (die den Großteil des Portfolios ausmachten) werden diese im Detail im ersten Abschnitt der nachstehenden Tabelle („**Staatliche PAIs**“) und bei Unternehmensemittenten (die „**PAIs für Unternehmensemittenten**“) im zweiten Abschnitt aufgeführt (zusammen die „**PAIs**“):

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

| PAIs | |
|---|---|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| Teil 1 – Staatliche PAIs | |
| Umwelt | PAI 15 – THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird |
| Soziales | PAI 16 - Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen |
| Teil 2 – PAIs für Unternehmensemittenten | |
| Treibhausgasemissionen | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind PAI 5 -Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren |
| Biodiversität | PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken |
| Wasser | PAI 8 - Emissionen in Wasser |
| Abfall | PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle |
| Soziales und Beschäftigung | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte ferner Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen und investierte nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung von Emittenten, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für die relevanten PAIs festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Emittenten, wenn sie unter die vom Sub-Investment-Manager für die relevanten PAIs festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben aufgeführten detaillierten NB-ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy identifiziert werden.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Sub-Investment-Manager prüfte die Auswirkungen der PAIs auf Nachhaltigkeitsfaktoren.

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

In Bezug auf das Portfolio erfolgte die Betrachtung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Emittenten, die quantitative und qualitative Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für die relevante PAI festgelegt wurden, unterschritten;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Emittenten, wenn sie unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben aufgeführten detaillierten NB-ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|--|---|-------------------------|-------------------------|
| OMAN GOVERNMENT BOND MTN RegS | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 2,9 % | Oman |
| CHILE (REPUBLIC OF) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 2,9 % | Chile |
| ARGENTINA REPUBLIC OF GOVERNMENT | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 2,7 % | Argentinien |
| ROMANIA (REPUBLIC OF) RegS | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 2,5 % | Rumänien |
| REPUBLIC OF PERU | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 2,5 % | Peru |
| DOMINICAN REPUBLIC (GOVERNMENT) RegS | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 2,3 % | Dominikanische Republik |
| REPUBLIC OF ARMENIA RegS | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 2,2 % | Armenien |
| MEXICO (UNITED MEXICAN STATES) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 2,1 % | Mexiko |
| SERBIA (REPUBLIC OF) RegS | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 2,0 % | Republik Serbien |
| BRAZIL FEDERATIVE REPUBLIC OF (GOV) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 2,0 % | Brasilien |
| MOROCCO (KINGDOM OF) RegS | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,9 % | Marokko |
| COSTA RICA REPUBLIC OF (GOVERNMENT) RegS | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,7 % | Costa Rica |
| MOROCCO KINGDOM OF (GOVERNMENT) RegS | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,7 % | Marokko |
| COLOMBIA (REPUBLIC OF) | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,7 % | Kolumbien |
| SERBIA (REPUBLIC OF) RegS | O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 1,6 % | Republik Serbien |

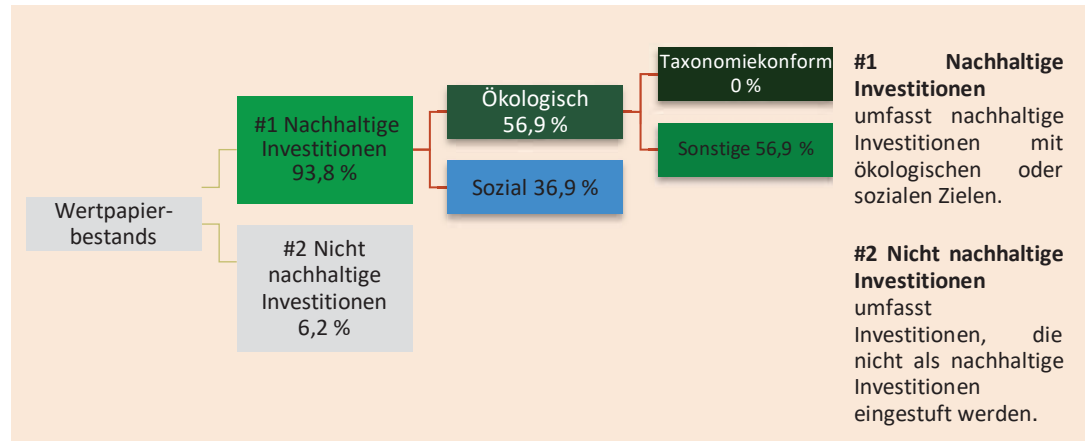
*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung können sein: Barclays Industry, Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?



Das Portfolio ist bestrebt, mindestens 80 % an nachhaltigen Investitionen zu halten. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 93,8 % an nachhaltigen Investitionen.

Das Portfolio zielt darauf ab, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht nachhaltig sind und unter die Kategorie „Nicht Nachhaltig“ des Portfolios fallen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 6,2 % an Investitionen der Kategorie „Nicht Nachhaltig“.

Die Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder Dritten beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|---|-------------------------|
| C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,2 % |
| H – Verkehr und Lagerei | 1,1 % |
| J – Information und Kommunikation | 0,1 % |
| K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 3,6 % |
| O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 90,7 % |
| U – Extraterritoriale Organisationen und Körperschaften | 0,9 % |
| Keine | 1,5 % |

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung können sein: Barclays Industry, Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.

Taxonomie-konforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

Betriebsausgaben (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für fossiles Gas Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für Kernenergie beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Wirtschaftstätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

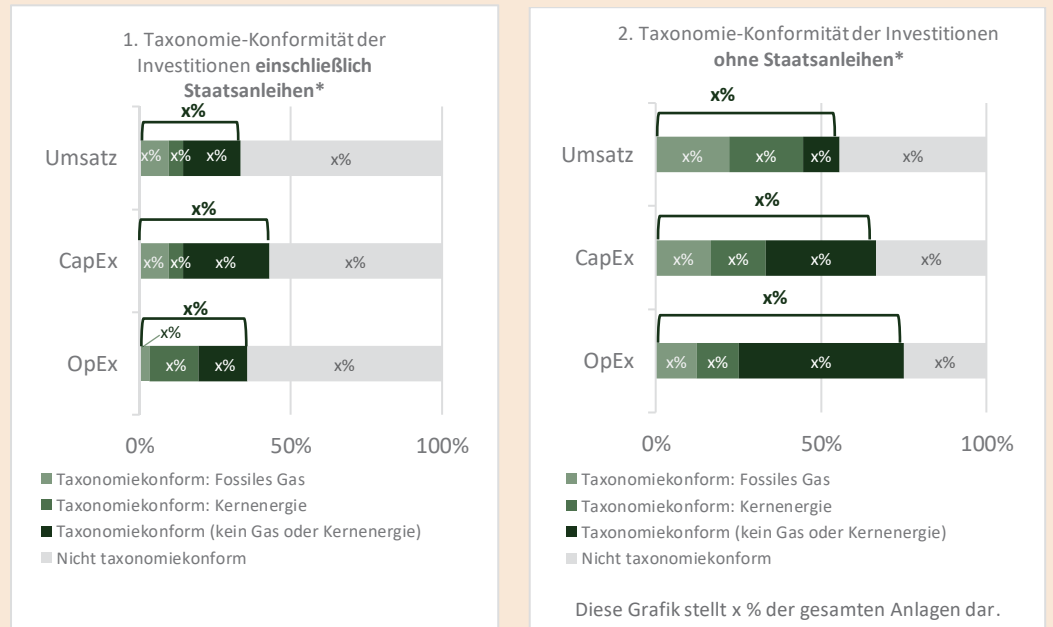
● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert³?

Ja: In fossiles Gas In Kernenergie

Nein

³ Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



sind ökologisch nachhaltige Investitionen, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden?

Das Portfolio hielt 56,9 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, das nicht mit der EU-Taxonomie konform ist.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Das Portfolio hielt 36,9 % an sozial nachhaltigen Investitionen.



Welche Investitionen fallen unter „nicht nachhaltige Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Nicht Nachhaltig“ umfasste die verbleibenden Anlagen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die sich nicht als nachhaltige Investitionen qualifizierten.

Die Investitionen der Kategorie „Nicht Nachhaltig“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Sub-Investment-Manager als notwendig für das ordnungsgemäße Funktionieren des Portfolios erachtete, z. B. die Gewährleistung einer angemessenen Liquidität, Absicherung und Besicherung.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager war der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine nachhaltigen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem nachhaltigen Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

i. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager verstand unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittentenanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigte daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit dem Nachhaltigkeitsziel des Portfolios, indem es (wie jeweils anwendbar) Berichte und Bewertungen von unabhängigen Dritten, den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete.

Der Indikator für die Entwicklung der Nachhaltigkeit von Staaten (dieser Indikator ist Eigentum des Sub-Investment-Managers) bewertete die Fortschritte staatlicher Emittenten bei der Anpassung an den Klimawandel und dem Klimaschutz, der Verringerung der THG-Emissionen und der Ausrichtung auf Netto-Null sowie bei der Erreichung der SDGs mit besonderem Schwerpunkt auf der öffentlichen Gesundheit und Bildung.

Der Sub-Investment-Manager führte zudem eine fortlaufende Analyse der ESG-Faktoren durch, indem er emittentenbezogene Bewertungen des NB-ESG-Quotienten erstellte und nutzte, um Risiken und Chancen bei der Gesamtbewertung der Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings konnten auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in seine internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der nachhaltigen Anlageziele des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

Emittenten mit einem günstigen NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn der Emittent keine diesbezüglichen Maßnahmen ergriffen hat, wurden nicht in das Portfolio aufgenommen.

| Bezugszeitraum | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | 53 | 1-100 | 98 % |
| Daten von Dritten | 4,3 | 0-10 | |

Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet. Für den NB-ESG-Quotient wird ein Rating zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 das niedrigste und 100 das höchste Rating darstellt. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindestrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung des nachhaltigen Anlageziels. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Bewertung der Daten Dritter reichen von 0–10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Der Sub-Investment-Manager tätigte keine Investitionen in staatlichen Emittenten, bei denen er eine schwache ESG-Praxis festgestellt hat. Diese Ausschlüsse basierten auf einer Reihe von ESG-Kriterien, darunter:

- Staatliche Emittenten, die auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten im untersten Dezil rangierten und bei denen keine Aussicht auf kurzfristige Verbesserungen bestanden;
- Staatliche Emittenten, die aufgrund von ESG-Erwägungen aus dem Referenzwert ausgeschlossen wurden; oder
- Staatliche Emittenten, deren führende Vertreter vom UN-Sicherheitsrat aufgrund von Menschenrechtsverletzungen mit Sanktionen belegt wurden; oder
- Staatliche Emittenten, bei denen eine hohe und steigende THG-Emissionsintensität festgestellt wurde; oder
- Staatliche Emittenten, bei denen schlechte und sich verschlechternde Kennzahlen für Menschenrechte und Rechtsstaatlichkeit festgestellt wurden; und
- staatliche Emittenten, die den vom Global Forum on Transparency and Exchange of Information for Tax Purposes der OECD aufgestellten Standard nicht einhielten, oder staatliche Emittenten, die von der FATF als Hochrisikoland eingestuft wurden.

ii. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

iii. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass das vom Portfolio beworbene nachhaltige Anlageziel erreicht wurde, wendete das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das nachhaltige Ziel des Finanzprodukts erreicht wird.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf das nachhaltige Investitionsziel bestimmt wird?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
k.A.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund (das „Portfolio“)

Unternehmenskennung: 5493005BLB45D11FOM10

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Nein

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 16,6 %* an nachhaltigen Investitionen**

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben**, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

*Das Portfolio führte zum 2. August 2023 eine Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen von 5 % ein. Die Angaben zu nachhaltigen Investitionen in dieser periodischen Berichtsvorlage wurden daher auf Grundlage des Durchschnitts aus den Werten zum Ende des dritten und vierten Quartals 2023 (als die einzigen Quartalsenden nach Einführung der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen) erstellt. Die Zahlen zu den nachhaltigen Investitionen sind, bedingt durch die uneinheitlichen Bezugszeiträume, nicht in der Tabelle zur Vermögensallokation enthalten.

**Weitere Einzelheiten zur Vermögensallokation des Portfolios (einschließlich des Engagements in nachhaltigen Investitionen) finden Sie nachfolgend unter der Frage „Wie hoch war der Anteil der *nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen*?“.

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken,

das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO₂-Fußabdrucks, Umweltmanagement, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, Gelegenheiten für erneuerbare Energien, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikoübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen in der Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigte der Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („NB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektoorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergriffen hat, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühte sich der Manager, konstruktiven Dialogen bei Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

| Bezugszeitraum | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | 63 | 1-100 | 90 % |
| Daten von Dritten | 6,8 | 0-10 | |

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet. Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmensemittenten gemessen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und Chancen durch den Klimawandel pro Emission und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit eine Emission durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 5,3 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 52 %, was einem Durchschnitt der vier Kalenderquartalsenden entspricht.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen. Ferner durften für das Portfolio keine Wertpapiere von Emittenten gekauft werden, die an der Herstellung von Tabakprodukten wie Zigarren, Zigaretten, E-Zigaretten, rauchfreiem Tabak, auflösbarem Tabak und Kautabak beteiligt waren. Dies schloss auch Emittenten ein, die Rohabakblätter anbauen oder verarbeiten.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. Der NB-ESG-Quotient

| | NB-ESG-Quotient-Rating | Rating der Daten durch externe Anbieter | Kombinierte Abdeckung |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| Bereich | 1-100 | 0-10 | 0-100 % |
| Bezugszeitraum 2022 | 62 | 6,5 | 87 % |
| Bezugszeitraum 2023 | 63 | 6,8 | 90 % |

Die Bewertung des NB-ESG-Quotienten hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

Das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen sowie auf potenzielle Änderungen oder Unterschiede im externen Emittenten-Rating.

2. CVaR

| | CVaR | Abdeckung |
|----------------------------|-------------|------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | -5,3 % | 52 % |
| Bezugszeitraum 2023 | -5,3 % | 52 % |

Die CVaR-Prognose ist im Vergleich zum Vorjahr unverändert geblieben.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

| | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|--------------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0 |
| Bezugszeitraum 2023 | 0 |

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es während des Bezugszeitraums kein nachhaltiges Anlageziel. Seit dem 2. August 2023 hat sich das Portfolio dazu verpflichtet, mindestens 5 % nachhaltige Investitionen zu halten. Die nachhaltigen Investitionen bewarben die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat (wie nachstehend erläutert) und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Emittenten, um festzustellen, ob der Emittent einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Emittenten auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet war.

Der Manager überprüfte die Emittenten auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Emittenten dieser Prüfung standhielten, quantifizierte der Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag der Emittenten zur Wirtschaft.

Der Manager erfasste dies auf zwei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDGs“).

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbaren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltige Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Ab dem 2. August 2023 wendet der Manager seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigen. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und auf Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Manager berücksichtigte bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die folgenden Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „PAIs“), die in der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind:

| PAIs | |
|-----------------------------------|---|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgasemissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind PAI 5 - Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren |
| <i>Biodiversität</i> | PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken |
| <i>Wasser</i> | PAI 8 - Emissionen in Wasser |
| <i>Abfall</i> | PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

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 Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Manager berücksichtigte ferner Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen und investierte nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

— — — *Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Manager bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Emittenten, die unter die vom Manager für jede PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Emittenten, wenn sie unter die vom Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

— — — *Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:*

das Portfolio investierte nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager) berücksichtigt.

Der Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „*Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?*“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.
2. Der Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| PAIs auf Produktebene | |
|-------------------------------|--|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgasemissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird |

| | |
|-----------------------------------|---|
| | PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | <p>PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen</p> <p>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen</p> <p>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)</p> |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel, die vom Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem über die vier Kalenderquartalsenden des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitt basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|--|--|-------------------------|-------------|
| INTESA SANPAOLO SPA MTN RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 1,69 % | Italien |
| DPF 21-2 A RegS | k.A. | 1,43 % | Niederlande |
| MYLAN NV RegS | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 1,42 % | USA |
| LANDSBANKINN HF RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 1,25 % | Island |
| SUMITOMO MITSUI BANKING CORPORATIO RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 1,24 % | Japan |
| BANK OF NOVA SCOTIA RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 1,20 % | Kanada |
| MIRAV_19-1 A RegS | k.A. | 1,19 % | Spanien |
| FEDERATION DES CAISSES DESJARDINS RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 1,12 % | Kanada |
| ATHENE GLOBAL FUNDING RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 1,05 % | USA |
| BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL MTN | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 1,02 % | Frankreich |
| MORGAN STANLEY MTN | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 1,00 % | USA |
| WIZZ AIR FINANCE COMPANY BV MTN RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 0,98 % | Schweiz |
| AMCO ASSET MANAGEMENT COMPANY SPA MTN RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 0,96 % | Italien |
| HOLCIM FINANCE LUX SA | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 0,91 % | Schweiz |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE MTN RegS | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 0,90 % | USA |



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

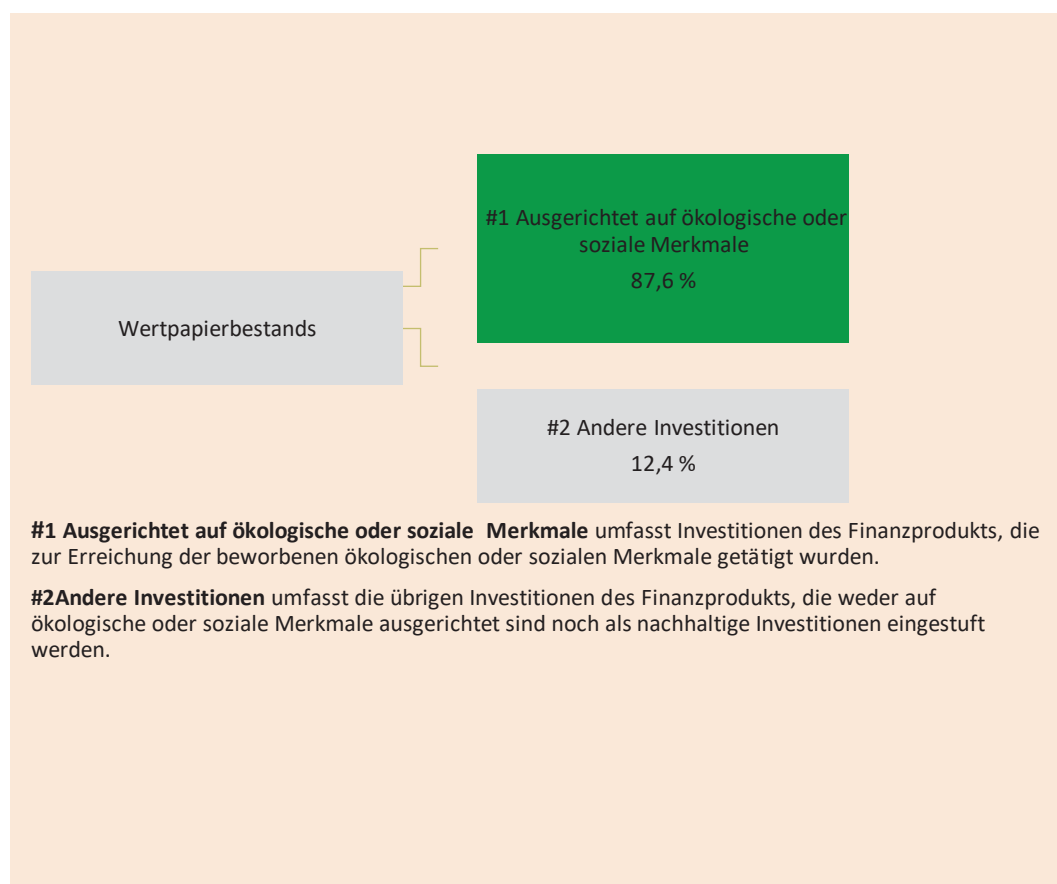
Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 70 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 87,6 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio führte zum 2. August 2023 eine Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen von 5 % ein. Die Angaben zu nachhaltigen Investitionen in diesem periodischen Bericht wurden daher auf Grundlage des Durchschnitts zum dritten und vierten Quartalsende 2023 (als die einzigen Quartalsenden nach Einführung der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen) erstellt. Das Portfolio hielt 16,6 % an nachhaltigen Investitionen.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

- Das Portfolio strebt danach, maximal 30 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 12,4 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Der Bezugszeitraum für die nachstehenden Daten ist ein Durchschnitt der vier Quartalsenden 2023, mit Ausnahme der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen. In diesem Falle wurden die Daten lediglich für diesen Bezugszeitraum auf Grundlage des Durchschnitts zum Ende des dritten und vierten Quartals 2023 erstellt.



Der prozentuale Anteil der nachhaltigen Investitionen als Durchschnitt des dritten und vierten Quartals 2023 betrug 16,6 %. Darin enthalten sind 12,6 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, und 4,0 % an sozial nachhaltigen Investitionen. Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Bildung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|--|-------------------------|
| C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 8,2 % |
| D – Energieversorgung | 2,2 % |
| E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen | 0,3 % |
| G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 0,5 % |
| H – Verkehr und Lagerei | 1,7 % |
| I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie | 0,1 % |
| J – Information und Kommunikation | 2,0 % |
| K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 64,6 % |
| L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 5,0 % |
| N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 3,7 % |
| O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung* | 6,3 % |
| R – Kunst, Unterhaltung und Erholung | 0,7 % |
| U – Extraterritoriale Organisationen und Körperschaften | 0,7 % |
| Keine | 4,0 % |

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Bei-trag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätig-keiten** sind Tätig-keiten, für die es noch keine CO₂-armen Alter-nativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

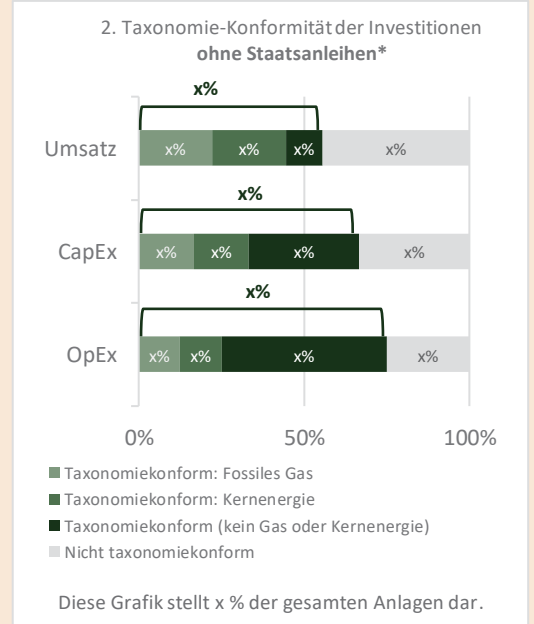
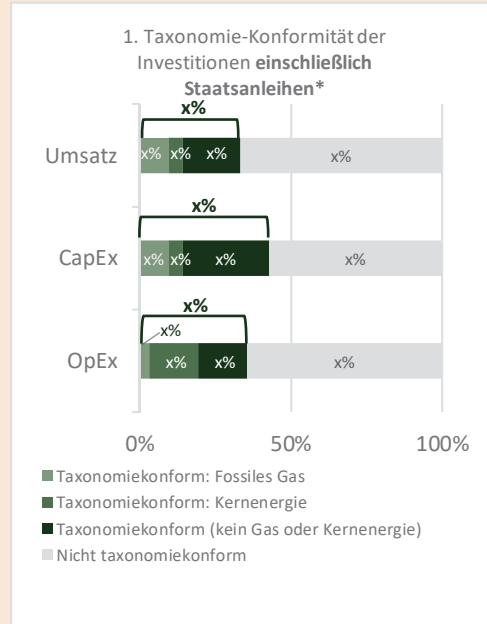
- Ja:
 In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

¹ Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Das Portfolio führte zum 2. August 2023 eine Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen von 5 % ein. Die Angaben zu nachhaltigen Investitionen in dieser periodischen Berichtsvorlage wurden daher auf Grundlage des Durchschnitts aus den Werten zum Ende des dritten und vierten Quartals 2023 (als die einzigen Quartalsenden nach Einführung der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen) erstellt. Das Portfolio hielt 12,6 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, das nicht mit der EU-Taxonomie konform ist.



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?

Das Portfolio führte zum 2. August 2023 eine Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen von 5 % ein. Die Angaben zu nachhaltigen Investitionen in dieser periodischen Berichtsvorlage wurden daher auf Grundlage des Durchschnitts aus den Werten zum Ende des dritten und vierten Quartals 2023 (als die einzigen Quartalsenden nach Einführung der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen) erstellt. Das Portfolio hielt 4,0 % an sozial nachhaltigen Investitionen.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder zur Gewährleistung einer adäquaten Liquidität, Absicherung und Besicherung.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittentenanalysen durch die Investmentteams des Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in seine internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Manager arbeitete mit den Emittenten über ein solides ESG-Dialogprogramm zusammen. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung der Mitwirkung verfolgt.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman US Equity Fund (das „Portfolio“)

Unternehmenskennung: 549300GF328Y6TQJI517

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| <input checked="" type="checkbox"/> <input checked="" type="checkbox"/> <input type="checkbox"/> Ja | <input checked="" type="checkbox"/> <input type="checkbox"/> <input checked="" type="checkbox"/> Nein |
|--|---|
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___% <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht 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 ___% an nachhaltigen Investitionen. <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 |
| <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 |

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzmitteln und zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Anreize für Mitarbeiter und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsnormen in der Lieferkette, Vielfalt und Integration der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortungsvolles Marketing.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („MB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wurde unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistenteam für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Unternehmen mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient- oder externen Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Unternehmen mit einem schlechten NB-ESG-Quotient- oder externen Rating, insbesondere dann, wenn ein Unternehmen diesbezüglich keine Maßnahmen ergriff, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus überwacht der Sub-Investment-Manager fortlaufend Unternehmen mit einem unterdurchschnittlichen oder schlechten NB-ESG-Quotient- oder externen Rating, um zu verstehen, wie sie besagte ESG-Bedenken mildern/verbessern.

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

| Bezugszeitraum | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|-----------------|-------------------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | ES: B G: 2,1 | ES: A-D G: 1-4 | 97 % |
| Daten von Dritten | 6,6 | 0-10 | |

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating der Aktienemittenten werden für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale („**ES**“) die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („**G**“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und der Chancen durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 6,8 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 96 %. Diese Deckung ist ein Durchschnitt der CVaR-Abdeckung über die vier Kalenderquartalsenden hinweg.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstießen oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischen Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

| | NB-ESG-Quotient-Rating | Rating der Daten durch externe Anbieter | Kombinierte Abdeckung |
|----------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| Bereich | ES: A-D G: 1-4 | 0-10 | 0-100 % |

| | | | |
|----------------------------|-----------------|-----|-------|
| Bezugszeitraum 2022 | ES: B G: 2,2 | 6,6 | 100 % |
| Bezugszeitraum 2023 | ES: B G: 2,1 | 6,6 | 97 % |

Das ES-Rating des NB-ESG-Quotienten ist im Vergleich zum Vorjahr unverändert geblieben, das G-Rating des NB-ESG-Quotienten hat sich jedoch verbessert. Die Bewertung der Daten Dritter blieb unverändert. Dies ist auf Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmen und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen sowie auf Unterschiede im externen Rating der Unternehmen.

2. CVaR

| | CVaR | Abdeckung |
|----------------------------|-------------|------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | -5,7 % | 91 % |
| Bezugszeitraum 2023 | -6,8 % | 96 % |

Die CVaR-Prognose hat sich im Vergleich zum Vorjahr aufgrund von einer verbesserten Datenabdeckung bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmen und Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmen sowie Handelsaktivitäten im Portfolio verändert.

Die CVaR-Abdeckung des Portfolios hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf eine verbesserte Datenabdeckung bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmen und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

| | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|--------------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0 |
| Bezugszeitraum 2023 | 0 |



Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager nicht in Unternehmen investiert, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die ILO-Normen, die UNGC-Grundsätze und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| PAIs auf Produktebene | |
|-----------------------------------|--|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgas-emissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|----------------------------|--|-------------------------|------|
| MICROSOFT CORP | J – Information und Kommunikation | 9,2 % | USA |
| AMAZON COM INC | G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 5,3 % | USA |
| APPLE INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 4,8 % | USA |
| ALPHABET INC CLASS A | J – Information und Kommunikation | 4,5 % | USA |
| META PLATFORMS INC CLASS A | J – Information und Kommunikation | 3,8 % | USA |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 3,5 % | USA |
| NVIDIA CORP | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 3,3 % | USA |
| SALESFORCE INC | J – Information und Kommunikation | 3,3 % | USA |
| VISA INC | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 2,5 % | USA |
| MASTERCARD INC | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 2,4 % | USA |
| SERVICENOW INC | J – Information und Kommunikation | 2,4 % | USA |
| TJX INC | G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 2,2 % | USA |
| WORKDAY INC | J – Information und Kommunikation | 2,2 % | USA |
| MCDONALDS CORP | I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie | 2,1 % | USA |
| ADOBE INC | J – Information und Kommunikation | 2,1 % | USA |



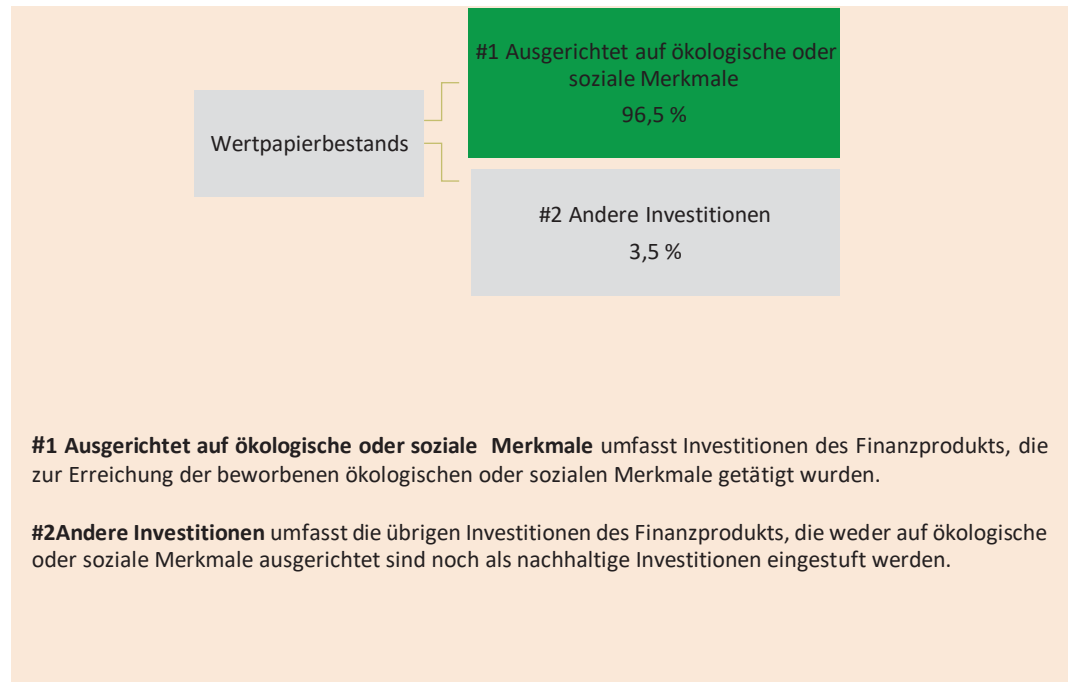
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 96,5 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 3,5 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|--|-------------------------|
| C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 22,6 % |
| D – Energieversorgung | 2,0 % |
| E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen | 1,6 % |
| G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 13,7 % |

| | |
|--|--------|
| H - Verkehr und Lagerei | 1,5 % |
| I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie | 2,6 % |
| J – Information und Kommunikation | 41,3 % |
| K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 12,1 % |
| L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 0,4 % |
| N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 2,0 % |
| Keine | 0,2 % |



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine 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?

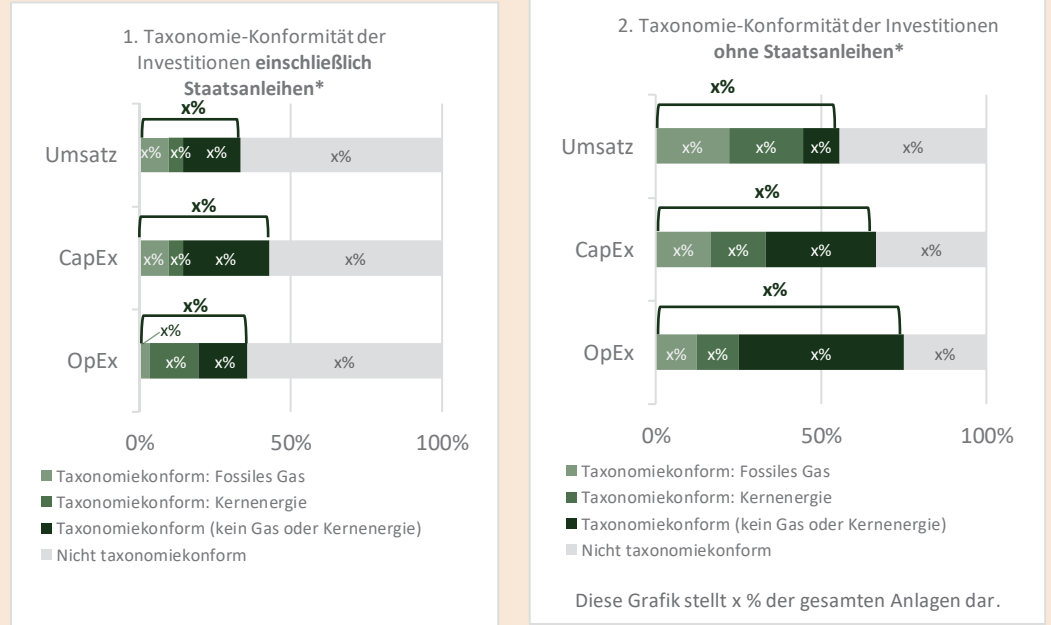
- Ja:
 In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

¹ Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde herangezogen, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient und das externe Rating) in die Gesamtbetrachtung der Unternehmen bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager trat in einen Dialog mit Unternehmen ein. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
k.A.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman US Large Cap Value Fund (das „Portfolio“)
Unternehmenskennung: 549300J88053TDGDP52

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Nein

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („**THG**“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzmitteln und zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Anreize für Mitarbeiter und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsnormen in der Lieferkette, Vielfalt und Integration der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortungsvolles Marketing.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Chancen und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**MB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient-Rating aufweisen, um eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachten) zu erreichen.

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Bezugszeitraum | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|-----------------|-------------------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | ES: B G: 2,2 | ES: A-D G: 1-4 | 95 % |
| Daten von Dritten | 6,6 | 0-10 | |

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale („ES“) werden die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („G“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („CVaR“) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und der Chancen durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 23,8 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als

Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 95 %. Diese Deckung ist ein Durchschnitt der CVaR-Abdeckung über die vier Kalenderquartalsenden hinweg.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren). Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischen Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. ESG-Quotient

| | NB-ESG-Quotient-Rating | Rating der Daten durch externe Anbieter | Kombinierte Abdeckung |
|----------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| Bereich | ES: A-D G: 1-4 | 0-10 | 0-100 % |

| | | | |
|----------------------------|-----------------|-----|-------|
| Bezugszeitraum 2022 | ES: B G: 2,0 | 6,8 | 100 % |
| Bezugszeitraum 2023 | ES: B G: 2,2 | 6,6 | 95 % |

Das ES-Rating des NB-ESG-Quotienten ist im Vergleich zum Vorjahr unverändert geblieben.

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich das G-Rating des NB-ESG-Quotienten aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmen und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verändert.

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die Bewertung der Daten Dritter aufgrund von Veränderungen bei den gehaltenen Unternehmen und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios sowie aufgrund von potenziellen Änderungen oder Unterschieden im externen Rating der Unternehmen verlagert.

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die kombinierte Abdeckung des NB-ESG-Quotienten und des externen Ratings aufgrund von Veränderungen bei den gehaltenen Unternehmen und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verlagert.

2. CVaR

| | CVaR | Abdeckung |
|----------------------------|---------|-----------|
| Bezugszeitraum 2022 | -18,5 % | 96 % |
| Bezugszeitraum 2023 | -23,8 % | 95 % |

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich der prognostizierte CVaR-Verlust aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmen und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios erhöht. Wie bereits erwähnt, kann die Szenarioanalyse als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken dienen, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die CVaR-Abdeckung aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmen und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verändert.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße.

| | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|-------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0 |
| Bezugszeitraum 2023 | 0 |



Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager nicht in Unternehmen investiert, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die ILO-Normen, die UNGC-Grundsätze und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, wichtigste nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren zu berücksichtigen.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|--------------------------------|--|-------------------------|------------|
| JOHNSON & JOHNSON | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 4,1 % | USA |
| PROCTER & GAMBLE | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 4,0 % | USA |
| EXXON MOBIL CORP | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 3,4 % | USA |
| MERCK & CO INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 3,4 % | USA |
| JPMORGAN CHASE | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 3,2 % | USA |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC CLASS B | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 3,1 % | USA |
| DUKE ENERGY CORP | D – Energieversorgung | 3,1 % | USA |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,7 % | USA |
| SEMPRA | D – Energieversorgung | 2,7 % | USA |
| DTE ENERGY | D – Energieversorgung | 2,6 % | USA |
| WALMART INC | G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 2,6 % | USA |
| PFIZER INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,5 % | USA |
| EXELON CORP | D – Energieversorgung | 2,4 % | USA |
| NEWMONT | B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden | 2,2 % | USA |
| RIO TINTO ADR REPTG ONE PLC | B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden | 2,1 % | Australien |



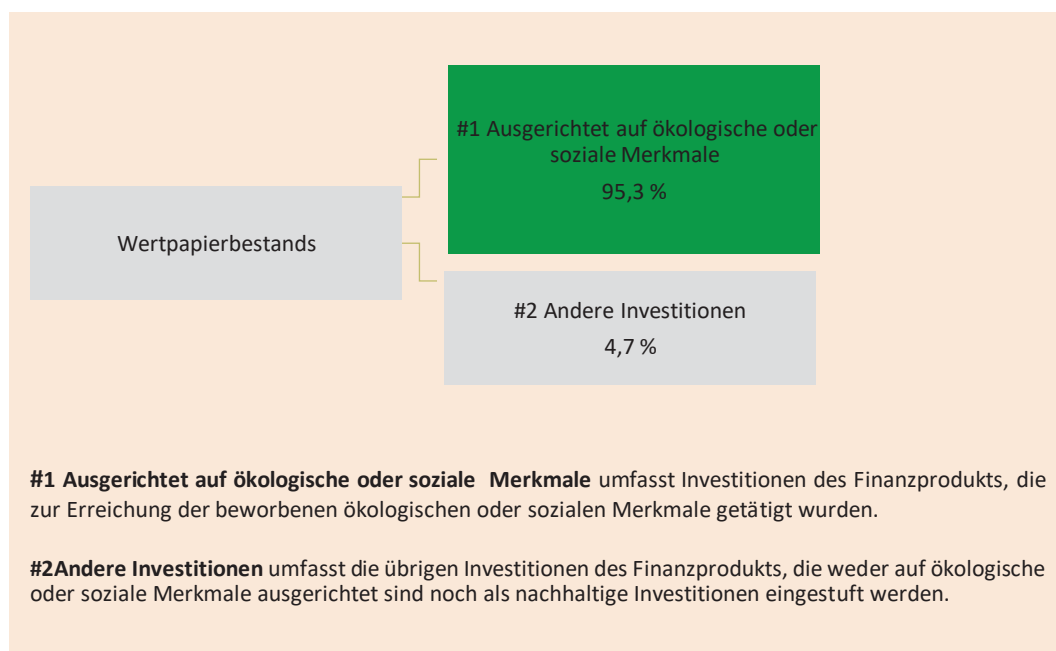
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 75 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 95,3 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 25 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 4,7 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|--|-------------------------|
| B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden | 8,3 % |
| C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 48,3 % |
| D – Energieversorgung | 15,8 % |
| E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen | 0,2 % |
| G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 4,4 % |
| H - Verkehr und Lagerei | 0,3 % |
| I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie | 1,5 % |
| J – Information und Kommunikation | 4,3 % |
| K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 15,1 % |
| L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 0,1 % |

| | |
|--|-------|
| Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen | 0,3 % |
| M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Tätigkeiten | 1,4 % |



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

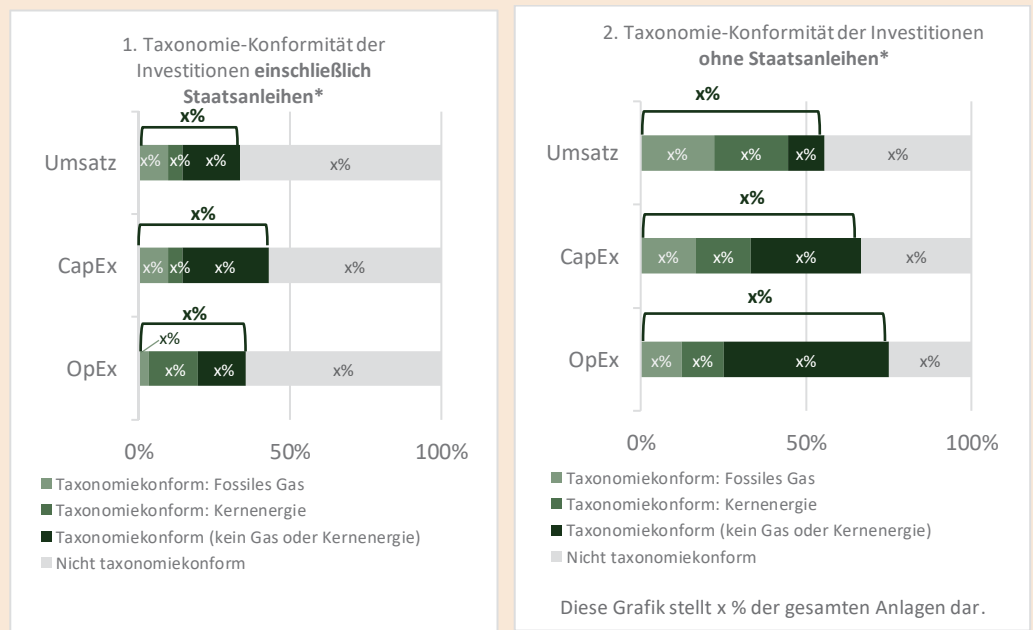
● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

- Ja:
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

¹ Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde herangezogen, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die Gesamtbetrachtung der Unternehmen bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
k.A.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman US Long Short Equity Fund (das „Portfolio“)

Unternehmenskennung: 54930034RCIO16VO2Z23

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> Ja | <input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Nein |
|---|---|
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___% <ul style="list-style-type: none"><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht 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 ___% an nachhaltigen Investitionen. <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 |
| <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 wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“).

Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?



Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzmitteln und zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Anreize für Mitarbeiter und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsnormen in der Lieferkette, Vielfalt und Integration der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortungsvolles Marketing.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Der ESG-Rahmen fand auf das Long-Segment des Portfolios Anwendung, das einen mehrjährigen Anlagehorizont verfolgt. Die Short-Positionen des Sub-Investment-Managers werden über Derivate zum Ausdruck gebracht und waren daher nicht zur Berücksichtigung von ESG-Faktoren verpflichtet. Genauere Angaben zur erwarteten Long/Short-Allokation des Portfolios finden sich im Abschnitt „*Anlageansatz*“ des Nachtrags.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („NB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentrierte, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen werden. Jedes Sektoorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteten ESG-Daten erstellt. Ergänzend kommen interne qualitative Analysen hinzu, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams des Sub-Investment-Managers genutzt wird. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Unternehmen mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient- oder externen Rating hatten eine bessere Chance, in das Long-Segment des Portfolios aufgenommen zu werden. Unternehmen mit einem schlechten NB-ESG-Quotient- oder externen Rating, insbesondere dann, wenn ein Unternehmen diesbezüglich keine Maßnahmen ergriff, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Long-Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Long-Segment des Portfolios entfernt. Darüber hinaus bemühte sich der Sub-Investment-Manager, konstruktiven Dialogen bei Emittenten mit

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

einem schlechten NB-ESG-Quotient- oder externen Rating Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Bezugszeitraum | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | ES: B | ES: A-D | 81 % |
| | G:2.2 | G: 1-4 | |
| Daten von Dritten | 6,3 | 0-10 | |

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale („**ES**“) werden die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („**G**“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0 bis 10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und der Chancen durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 21,5 % führen

könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 68 %. Diese Deckung ist ein Durchschnitt der CVaR-Abdeckung über die vier Kalenderquartalsenden hinweg.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstießen oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischen Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Lediglich Long-Positionen wurden durch die vorstehend aufgeführte NB-ESG-Ausschlusspolitik abgedeckt.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

| | NB-ESG-Quotient-Rating | Rating der Daten durch externe Anbieter | Kombinierte Abdeckung |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| Bereich | ES: A-D G: 1-4 | 0-10 | 0-100 % |
| Bezugszeitraum 2022 | ES: B G: 2,2 | 6,5 | 98 % |
| Bezugszeitraum 2023 | ES: B G: 2,2 | 6,3 | 81 % |

Im Vergleich zum Vorjahr blieb das ES-Rating des NB-ESG-Quotienten unverändert, das G-Rating des NB-ESG-Quotienten blieb unverändert und die Bewertung der Daten Dritter hat sich verschlechtert. Dies ist auf Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmen und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen sowie auf Unterschiede im externen Rating der Unternehmen.

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die kombinierte Abdeckung durch den NB-ESG-Quotienten und das externe Rating verschlechtert.

Angesichts des Engagements des Portfolios in Short-Positionen (die nicht als Investitionen erachtet werden, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen) kann es eine Herausforderung sein, ein hohes Niveau der kombinierten Abdeckung im gesamten Portfolio aufrechtzuerhalten. Die ESG-Analyse wird intern durchgeführt, mit Unterstützung durch die Daten externer Anbieter, und nicht ausgelagert. Der Sub-Investment-Manager nimmt auf kontinuierlicher Basis Bewertungen dieser ESG-Merkmale vor. Von Zeit zu Zeit kann es vorkommen, dass einem Unternehmen zum Zeitpunkt der Anlage für einen kurzen Zeitraum kein NB-ESG-Quotient-Rating zugewiesen wird. Der Sub-Investment-Manager steht in regelmäßigen Abständen mit externen Anbietern von ESG-Daten in Kontakt, um Themen wie die Datenabdeckung zu diskutieren und Optionen zur Behebung von Datenlücken zu prüfen. Die Nutzung mehrerer externer Anbieter von ESG-Daten ermöglicht es dem Sub-Investment-Manager, die Datenabdeckung und die Qualität der Daten der externen Anbieter von ESG-Daten zu bewerten. Darüber hinaus prüft der Sub-Investment-Manager weiterhin neue ESG-Datenprodukte und externe Anbieter von ESG-Daten, um potenzielle Verbesserungen unserer bestehenden ESG-Datenabdeckung zu bewerten.

2. CVaR

| | CVaR | Abdeckung |
|----------------------------|-------------|------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | -16,6 % | 59 % |
| Bezugszeitraum 2023 | -21,5 % | 68 % |

Der durch die CVaR prognostizierte Verlust ist im Vergleich zum Vorjahr aufgrund einer verbesserten Datenabdeckung bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmen und der Handelsaktivitäten im Portfolio gestiegen. Wie bereits erwähnt, kann die Szenarioanalyse als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken dienen, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Die CVaR-Abdeckung des Portfolios hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf eine verbesserte Datenabdeckung bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmen und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße.

| | Gesamtzahl der Verstöße |
|---------------------|-------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0 |
| Bezugszeitraum 2023 | 0 |

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

— **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

— **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager nicht in Unternehmen investiert, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – Dieses Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, wichtigste nachteilige Auswirkungen zu berücksichtigen.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|----------------------------|--|-------------------------|------|
| MICROSOFT CORP | J – Information und Kommunikation | 4,0 % | USA |
| APPLE INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,7 % | USA |
| AMAZON COM INC | G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 2,6 % | USA |
| ALPHABET INC CLASS A | J – Information und Kommunikation | 2,5 % | USA |
| META PLATFORMS INC CLASS A | J – Information und Kommunikation | 2,5 % | USA |
| SALESFORCE INC | J – Information und Kommunikation | 2,4 % | USA |
| MCDONALDS CORP | I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie | 2,3 % | USA |
| TJX INC | G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 2,2 % | USA |
| ADOBE INC | J – Information und Kommunikation | 2,0 % | USA |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 1,9 % | USA |
| UNION PACIFIC CORP | H - Verkehr und Lagerung | 1,9 % | USA |
| NEXTERA ENERGY INC | D – Energieversorgung | 1,9 % | USA |
| CME GROUP INC CLASS A | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 1,7 % | USA |
| KEURIG DR PEPPER INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 1,7 % | USA |
| S&P GLOBAL INC | J – Information und Kommunikation | 1,7 % | USA |

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

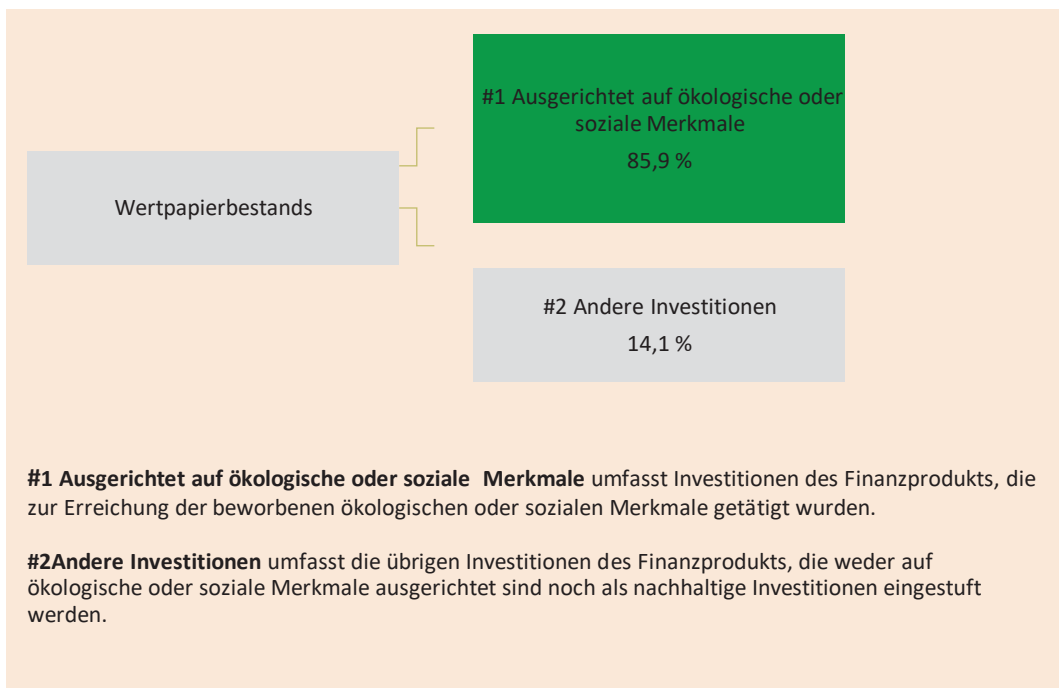


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 60 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 85,9 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 40 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 14,1 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|--|-------------------------|
| C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 23,3 % |
| D – Energieversorgung | 5,5 % |
| E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen | 1,2 % |
| G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 12,7 % |
| H - Verkehr und Lagerei | 3,2 % |
| I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie | 3,7 % |
| J – Information und Kommunikation | 31,6 % |
| K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 12,0 % |
| L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 2,1 % |
| M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen | 0,9 % |
| N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 1,5 % |
| O – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen | 0,7 % |
| S – Sonstige Dienstleistungen | 0,2 % |
| Keine | 1,4 % |

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine 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?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?**

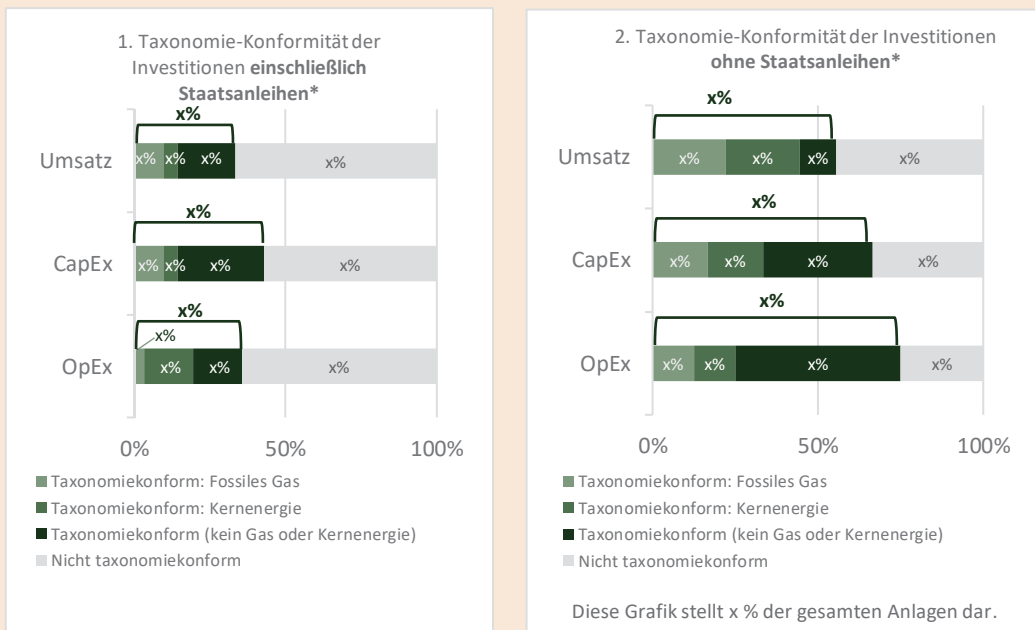
Ja:
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

¹ Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient- oder externe Rating für Unternehmen wurde herangezogen, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient und das externe Rating) in die Gesamtbetrachtung der Unternehmen bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager trat in einen Dialog mit Unternehmen ein. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen

Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses für das Long-Segment. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die im Long-Segment des Portfolios beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Long-Segment des Portfolios die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.

Wie vorstehend erwähnt, werden lediglich Long-Positionen durch die vorstehend aufgeführte NB-ESG-Ausschlusspolitik abgedeckt.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

k.A.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

k.A.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

k.A.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman US Multi Cap Opportunities Fund (das „Portfolio“)

Unternehmenskennung: 549300K77TBAIVA0NY51

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

- Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
 - in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Nein

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___ % an nachhaltigen Investitionen

- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzmitteln und zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Anreize für Mitarbeiter und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsnormen in der Lieferkette, Vielfalt und Integration der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortungsvolles Marketing.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („MB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wurde unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient-Rating aufweisen, um eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachten) zu erreichen.

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

| Bezugszeitraum | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|----------------|-----------------------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | ES:B G: 2,2 | ES: A-D G: 1-4 | 99 % |
| Daten von Dritten | 6,2 | 0-10 | |

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale („**ES**“) werden die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („**G**“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und der Chancen durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 15,6 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller

klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 99 %. Diese Deckung ist ein Durchschnitt der CVaR-Abdeckung über die vier Kalenderquartalsenden hinweg.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstießen oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischen Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

| | NB-ESG-Quotient-Rating | Rating der Daten durch externe Anbieter | Kombinierte Abdeckung |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| Bereich | ES: A-D G: 1-4 | 0-10 | 0-100 % |
| Bezugszeitraum 2022 | ES: C G: 2,3 | 6,2 | 99 % |
| Bezugszeitraum 2023 | ES: B G: 2,2 | 6,2 | 99 % |

Das ES-Rating des NB-ESG-Quotienten hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert, das G-Rating des NB-ESG-Quotienten hat sich verbessert und Bewertung der Daten Dritter ist unverändert geblieben. Dies ist auf Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmen und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen sowie auf Unterschiede im externen Rating der Unternehmen.

2. CVaR

| | CVaR | Abdeckung |
|----------------------------|---------|-----------|
| Bezugszeitraum 2022 | -12,6 % | 99 % |
| Bezugszeitraum 2023 | -15,6 % | 99 % |

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die CVaR-Prognose aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmen und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verändert.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

| | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|-------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0 |
| Bezugszeitraum 2023 | 0 |

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager nicht in Unternehmen investiert, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die ILO-Normen, die UNGC-Grundsätze und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| PAIs auf Produktebene | |
|-----------------------------------|--|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgasemissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|--------------------------------|--|-------------------------|--------|
| BERKSHIRE HATHAWAY INC CLASS B | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 5,2 % | USA |
| ALPHABET INC CLASS C | J – Information und Kommunikation | 4,9 % | USA |
| MICROSOFT CORP | J – Information und Kommunikation | 4,4 % | USA |
| APPLE INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 4,3 % | USA |
| GRAPHIC PACKAGING HOLDING | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 4,1 % | USA |
| HCA HEALTHCARE INC | Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen | 3,5 % | USA |
| CSX CORP | H – Verkehr und Lagerung | 3,3 % | USA |
| BROOKFIELD CORP | L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 3,2 % | Kanada |
| ARAMARK | I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie | 3,1 % | USA |
| JPMORGAN CHASE | K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 3,1 % | USA |
| T MOBILE US INC | J – Information und Kommunikation | 3,1 % | USA |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 3,1 % | USA |
| AMAZON COM INC | G – Handel: Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 2,9 % | USA |
| US FOODS HOLDING CORP | G – Handel: Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 2,7 % | USA |
| BECTON DICKINSON | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,3 % | USA |



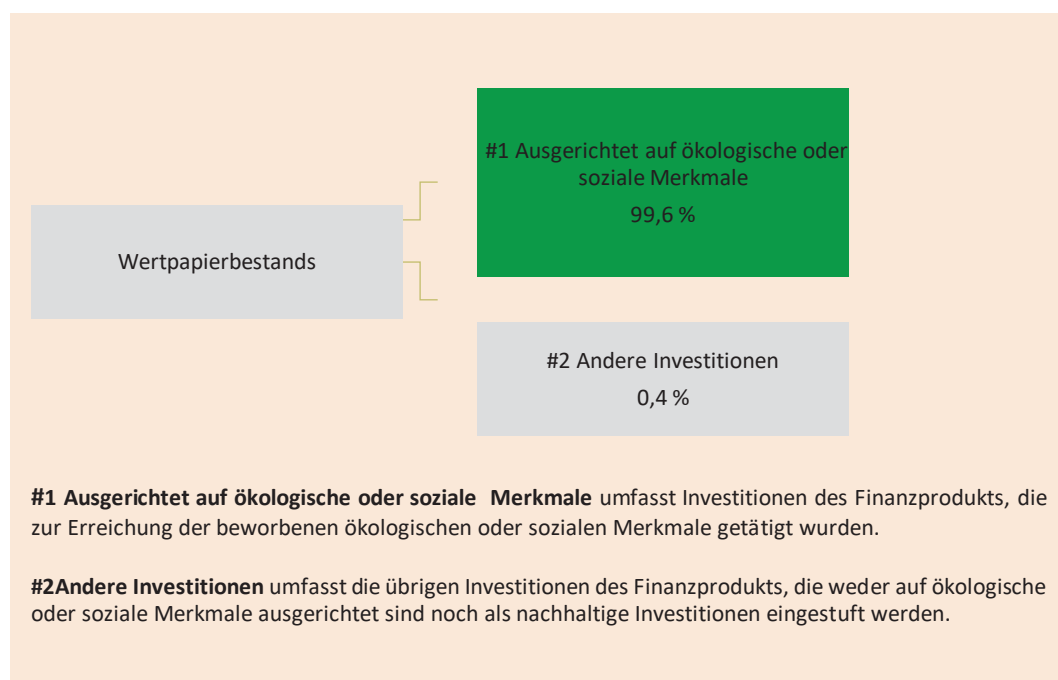
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 99,6 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 0,4 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnungen basierten auf Marktbewertungen des Portfolios und können auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder Dritten basieren. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|--|-------------------------|
| B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden | 1,5 % |
| C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 35,2 % |
| D – Energieversorgung | 1,3 % |
| G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 11,7 % |
| H - Verkehr und Lagerei | 3,3 % |
| I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie | 5,4 % |
| J – Information und Kommunikation | 14,8 % |
| K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 18,8 % |
| L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 3,2 % |
| N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 1,4 % |
| Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen | 3,5 % |

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine 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?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

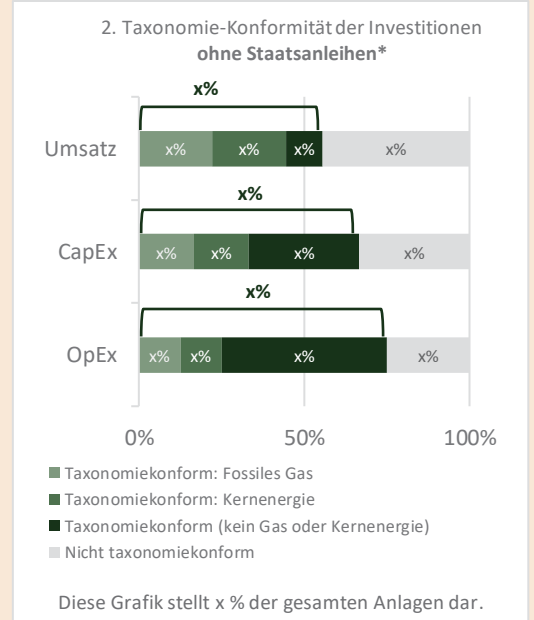
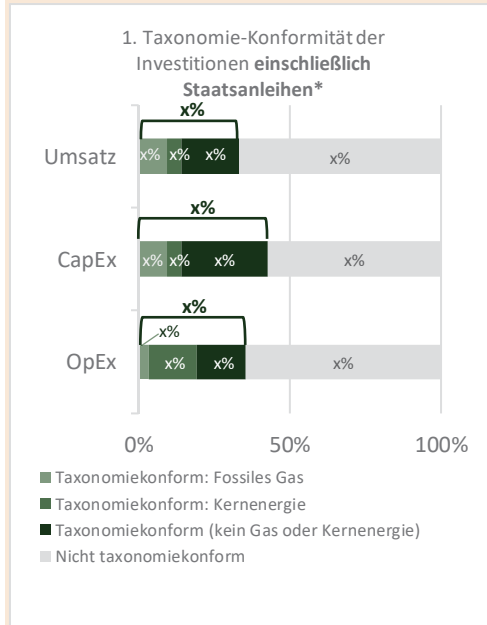
- Ja:
 In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

¹ Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde herangezogen, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die Gesamtbetrachtung der Unternehmen bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
k.A.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund (das „Portfolio“)

Unternehmenskennung: 549300T9PUOV1AK0OR82

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Nein

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Alle Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnitt der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („THG“)*, Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, und Materialbeschaffung.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Anreize für Mitarbeiter und Risikobereitschaft, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsnormen in der Lieferkette und Vielfalt und Integration der Belegschaft.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („MB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteten ESG-Daten erstellt. Ergänzend kommen interne qualitative Analysen hinzu, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistenteam des Sub-Investment-Managers genutzt wird. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergreift, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühte sich der Sub-Investment-Manager, konstruktiven Dialogen bei Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

| Bezugszeitraum | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|-----------------|-------------------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | ES: B G: 1,6 | ES: A-D G: 1-4 | 97 % |
| Daten von Dritten | 6,2 | 0-10 | |

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Im Hinblick auf die NB-ESG-Quotient-Ratings der Aktienemittenten werden für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale („ES“) die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („G“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („CVaR“) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und der Chancen durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 16,3 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige

Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 95 %. Die CVaR-Abdeckung des Bezugszeitraums ist ein Durchschnitt des CVaR über die vier Kalenderquartalsenden hinweg.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren). Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischen Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen. Der Sub-Investment-Manager schloss auch Investitionen in Emittenten aus, die private Gefängnisse besitzen, betreiben oder überwiegend wesentliche Dienstleistungen für diese erbringen. Die Gründe sind die erheblichen sozialen Kontroversen und die Reputationsrisiken sowie die Abhängigkeit von der Politik und den Einrichtungen der Justizministerien und der Politik der lokalen Regierung sowie der Umstand, dass diese Einrichtungen nicht ohne weiteres für andere Zwecke umgestaltet werden können.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

| | NB-ESG-Quotient-Rating | Rating der Daten durch externe Anbieter | Kombinierte Abdeckung |
|----------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| Bereich | ES: A-D | 0-10 | 0-100 % |

| | | | |
|----------------------------|-----------------|-----|-------|
| | G: 1-4 | | |
| Bezugszeitraum 2022 | ES: B G: 1,5 | 6,2 | 100 % |
| Bezugszeitraum 2023 | ES: B G: 1,6 | 6,2 | 97 % |

Das ES-Rating des NB-ESG-Quotienten ist im Vergleich zum Vorjahr unverändert geblieben, das G-Rating des NB-ESG-Quotienten hat sich jedoch verschlechtert. Die Bewertung der Daten Dritter blieb ebenfalls unverändert. Dies ist auf Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmen und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen sowie auf Unterschiede im externen Rating der Unternehmen.

2. CVaR

| | CVaR | Abdeckung |
|----------------------------|---------|-----------|
| Bezugszeitraum 2022 | -9,8 % | 93 % |
| Bezugszeitraum 2023 | -16,3 % | 95 % |

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich der prognostizierte CVaR-Verlust aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmen und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios erhöht. Wie bereits erwähnt, kann die Szenarioanalyse als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken dienen, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

| | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|-------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0 |
| Bezugszeitraum 2023 | 0 |



Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| PAIs auf Produktebene | |
|-----------------------------------|--|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgas-emissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbareren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|-------------------------------|--|-------------------------|------|
| AMERICAN TOWER REIT CORP | L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 8,4 % | USA |
| PROLOGIS REIT INC | L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 8,0 % | USA |
| PUBLIC STORAGE REIT | L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 7,2 % | USA |
| CROWN CASTLE INC | N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 5,6 % | USA |
| EQUINIX REIT INC | J – Information und Kommunikation | 5,3 % | USA |
| REALTY INCOME REIT CORP | L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 4,9 % | USA |
| WELLTOWER INC | L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 4,0 % | USA |
| VICI PPTYS INC | L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 3,7 % | USA |
| SIMON PROPERTY GROUP REIT INC | L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 3,6 % | USA |
| EXTRA SPACE STORAGE REIT INC | L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 3,4 % | USA |
| ESSEX PROPERTY TRUST REIT INC | L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 3,1 % | USA |
| APARTMENT INCOME REIT CORP | L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 3,0 % | USA |
| IRON MOUNTAIN INC | L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 3,0 % | USA |
| KIMCO REALTY REIT CORP | L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 2,8 % | USA |
| VENTAS REIT INC | L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 2,8 % | USA |



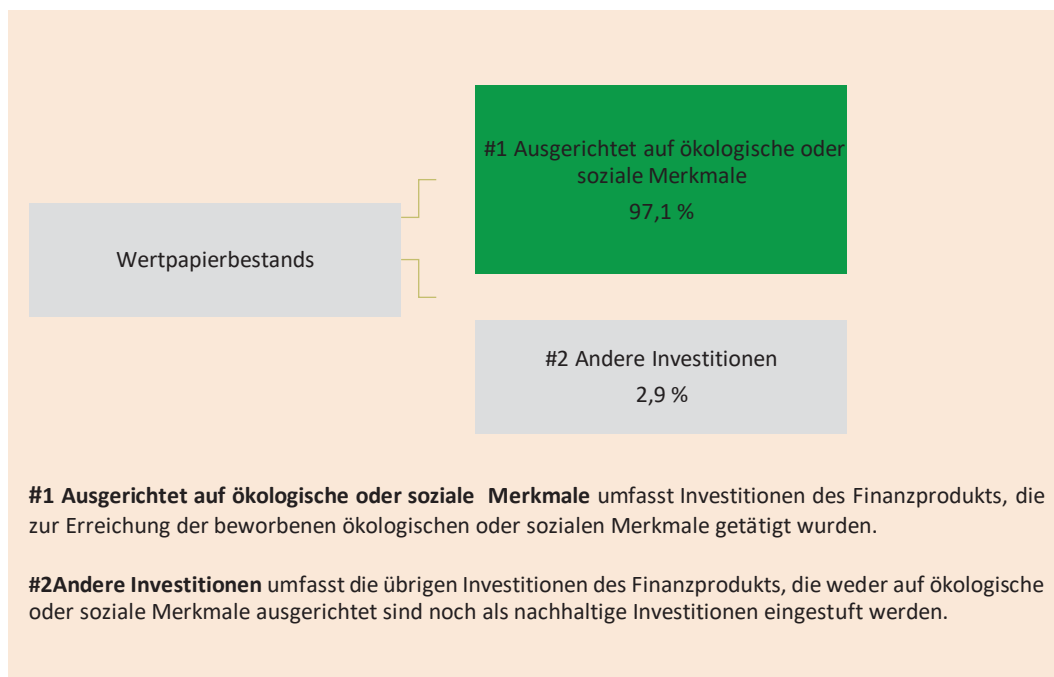
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 97,1 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 2,9 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|--|-------------------------|
| C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,8 % |
| J – Information und Kommunikation | 5,4 % |
| L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 86,1 % |
| N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 5,8 % |



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

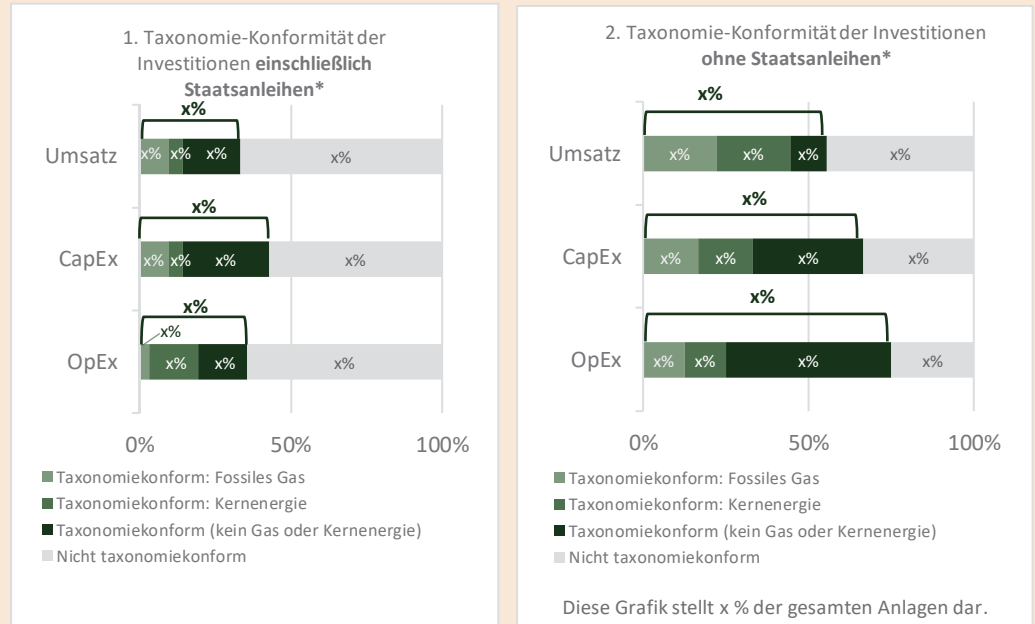
- Ja:
 In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

¹ Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittentenanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde herangezogen, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in seine Bewertung bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman US Small Cap Fund (das „Portfolio“)

Unternehmenskennung: 549300CG2QDECVFZQ378

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Nein

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzmitteln und zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Anreize für Mitarbeiter und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsnormen in der Lieferkette, Vielfalt und Integration der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortungsvolles Marketing.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „NB- ESG- Quotient“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („MB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wurde unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient-Rating aufweisen, um eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachten) zu erreichen.

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

| Bezugszeitraum | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|-----------------|-------------------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | ES: C G: 2,3 | ES: A-D G: 1-4 | 99 % |
| Daten von Dritten | 5,6 | 0-10 | |

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale („**ES**“) werden die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („**G**“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist. Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren). Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischen Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen. Das Portfolio erwarb keine Wertpapiere mehr von Unternehmen, die Schusswaffen herstellten oder mindestens 5 % ihrer Umsätze durch Tabak, Glücksspiele oder Erwachsenenunterhaltung erzielten.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

| | NB-ESG-Quotient-Rating | Rating der Daten durch externe Anbieter | Kombinierte Abdeckung |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| Bereich | ES: A-D G: 1-4 | 0-10 | 0-100 % |
| Bezugszeitraum 2022 | ES: C G: 2,3 | 5,4 | 100 % |
| Bezugszeitraum 2023 | ES: C G: 2,3 | 5,6 | 99 % |

Im Vergleich zum Vorjahr blieb das ES-Rating des NB-ESG-Quotienten unverändert, das G-Rating des NB-ESG-Quotienten blieb unverändert und die Bewertung der Daten Dritter hat sich verbessert. Dies ist unter Umständen auf Verbesserungen bei den einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmen gemäß externem Datenanbieter oder auf Differenzen des von dem Anbieter bereitgestellten externen Rating des Unternehmens zurückzuführen.

2. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

| | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|--------------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0 |
| Bezugszeitraum 2023 | 0 |

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager nicht in Unternehmen investiert, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die ILO-Normen, die UNGC-Grundsätze und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| PAIs auf Produktebene | |
|-----------------------------------|--|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |
| <i>Treibhausgasemissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO ₂ -Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts** entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|-----------------------------|--|-------------------------|------|
| LATTICE SEMICONDUCTOR CORP | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 2,6 % | USA |
| MANHATTAN ASSOCIATES INC | J – Information und Kommunikation | 2,3 % | USA |
| FAIR ISAAC CORP | J – Information und Kommunikation | 2,2 % | USA |
| POOL CORP | G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 2,1 % | USA |
| SPS COMMERCE INC | J – Information und Kommunikation | 2,0 % | USA |
| QUALYS INC | J – Information und Kommunikation | 1,9 % | USA |
| CHEMED CORP | Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen | 1,9 % | USA |
| RBC BEARINGS INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 1,8 % | USA |
| ASBURY AUTOMOTIVE GROUP INC | G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 1,8 % | USA |
| POWER INTEGRATIONS INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 1,7 % | USA |
| HAEMONETICS CORP | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 1,7 % | USA |
| BIO TECHNE CORP | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 1,7 % | USA |
| LITTELFUSE INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 1,6 % | USA |
| VALMONT INDS INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 1,6 % | USA |
| EAGLE MATERIALS INC | C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 1,6 % | USA |



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

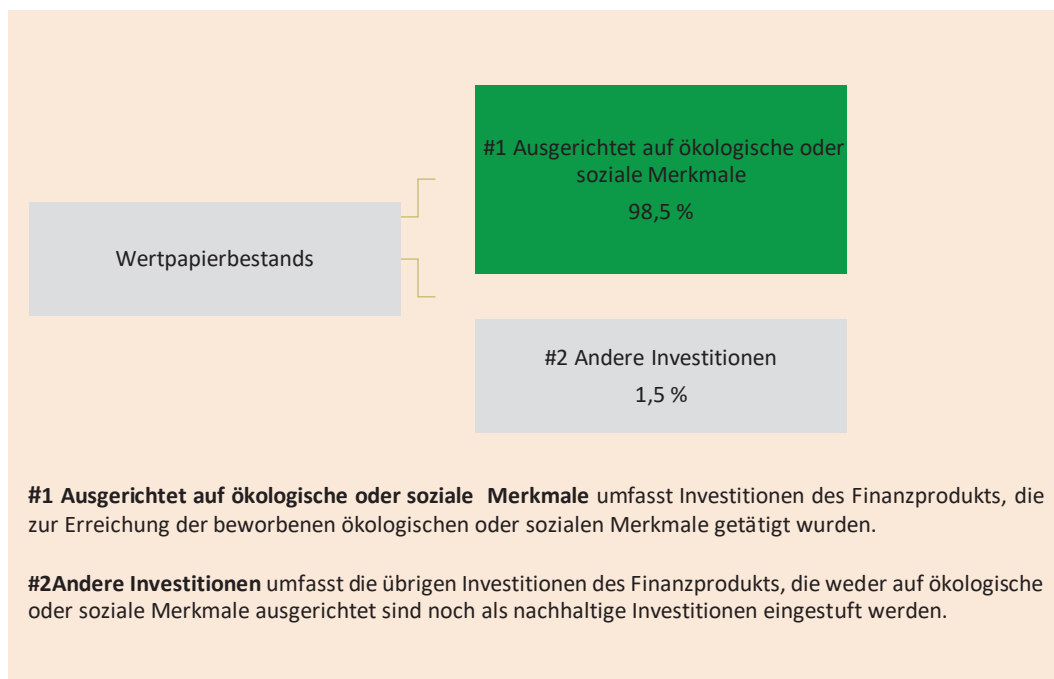
Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 98,5 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 1,5 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnungen basierten auf Marktbewertungen des Portfolios und können auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder Dritten basieren. Die Daten des

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

| Wirtschaftssektoren - NACE | In % der Vermögenswerte |
|--|-------------------------|
| B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden | 4,0 % |
| C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | 42,8 % |
| E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen | 0,1 % |
| G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen | 8,9 % |
| H - Verkehr und Lagerei | 2,2 % |
| I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie | 1,1 % |
| J – Information und Kommunikation | 16,6 % |
| K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten | 11,4 % |
| L – Grundstücks- und Wohnungswesen | 1,7 % |
| M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Tätigkeiten | 6,5 % |

| | |
|--|-------|
| N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen | 1,8 % |
| Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen | 2,9 % |



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

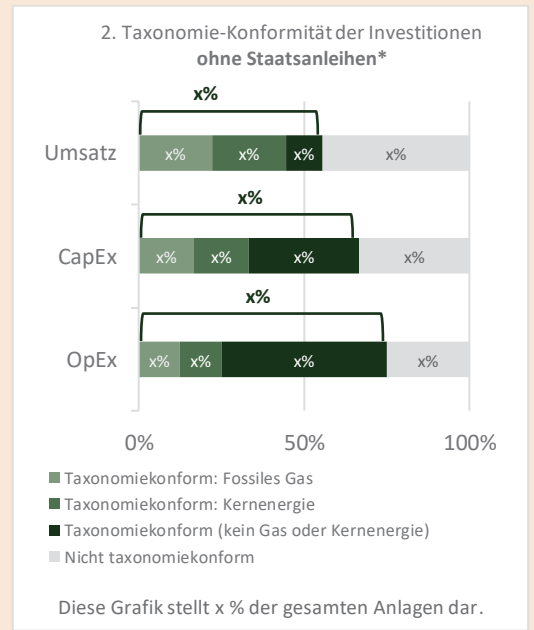
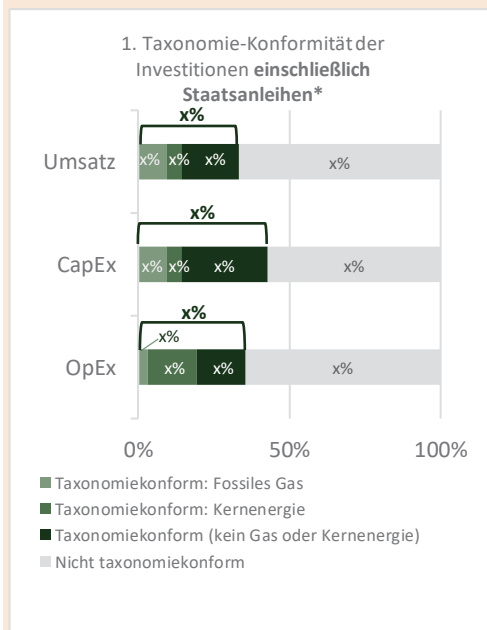
● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?**

- Ja:
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

¹ Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde herangezogen, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die Gesamtbetrachtung der Unternehmen bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
k.A.

Dieses Dokument wird von der Neuberger Berman Asset Management Ireland Limited („NBAMIL“) herausgegeben, die durch die irische Zentralbank (Irish Central Bank, „CBI“) zugelassen ist und reguliert wird und in Irland in 2 Central Plaza Dame Street, Dublin 2, eingetragen ist. Vertreter und Zahlstelle in der Schweiz ist BNP Paribas Securities Services, succursale de Zurich, Selnaustrasse 16, 8002 Zürich, Schweiz. Erfüllungsort und Gerichtsstand für Anteile an den Teilfonds des Fonds, die in oder von der Schweiz aus angeboten oder vertrieben werden, ist der Sitz des Vertreters in der Schweiz. Der Verkaufsprospekt, die wesentlichen Anlegerinformationen, die Satzung der Gesellschaft, der letzte geprüfte Jahresabschluss und der danach veröffentlichte Halbjahresabschluss des Fonds sind kostenfrei vom Vertreter in der Schweiz zu beziehen.

Neuberger Berman Investment Funds plc (der „Fonds“) ist von der Central Bank of Ireland (die „Zentralbank“) als Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren gemäß den Vorschriften von 2011 zur Umsetzung der EG-Richtlinie über Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2011 (S.I. 352 of 2011) of Ireland) in der jeweils gültigen Fassung („OGAW-Vorschriften“) zugelassen.

Dieses Dokument wurde ausschließlich für Informationszwecke zur Verfügung gestellt und/oder richtet sich nur an Personen, bei denen es sich um professionelle Kunden oder zulässige Gegenparteien handelt. Alle Informationen können sich ohne Mitteilung ändern. Kein Teil dieses Dokuments darf ohne die schriftliche Genehmigung von NBAMIL in irgendeiner Form vervielfältigt werden. Unternehmensdaten, wo relevant, einschließlich Zahlen zu Mitarbeitern und verwaltetem Vermögen, spiegeln die zusammengefassten Daten für die verschiedenen verbundenen Anlageberater wider, die Tochtergesellschaften der Neuberger Berman Group LLC (die „Gesellschaft“) sind. Die Daten aus der Historie/Zeitachse der Gesellschaft reichen zurück bis ins Jahr 1939, das Gründungsjahr von Neuberger & Berman (dem Vorgänger der Neuberger Berman Group LLC) und verdeutlichen die wesentlichen Expansionen des Unternehmens, einschließlich derer, die aus Übernahmen der verschiedenen verbundenen Anlageberater resultierten, die nun die Gesellschaft bilden. Zu den Anlageexperten auf die Bezug genommen wird, zählen Portfoliomanager, Researchanalysten/Partner, Händler und Produktspezialisten sowie ein Team aus spezialisierten Ökonomen/Strategen.

Neuberger Berman ist der Meinung, dass die Informationen zum Datum ihrer Erstellung richtig sind, aber Neuberger Berman gibt gegenüber dem Empfänger dieses Dokuments oder den Endnutzern diesbezüglich keinerlei Erklärungen oder Zusicherungen ab und übernimmt keinerlei Haftung für Handlungen, die auf Basis der hier enthaltenen Informationen durchgeführt werden. Entscheidungen sollten keinesfalls auf Grundlage der in diesem Dokument enthaltenen Informationen und Meinungen oder der Annahme, dass diese richtig oder vollständig sind, getroffen werden. Hierin zum Ausdruck gebrachte Meinungen entsprechen der Meinung der Neuberger Berman und können sich ohne Vorankündigung ändern. Der Fonds ist möglicherweise in manchen Ländern nicht zum Verkauf zugelassen und ist eventuell nicht für jeden Anlegertyp geeignet. Weitere Informationen sind dem aktuellen Verkaufsprospekt zu entnehmen. Zusätzliche Informationen finden Sie auf www.nb.com/europe/literature.html.

Festverzinsliche Wertpapiere unterliegen dem Risiko, dass ein Emittent seine mit der Verbindlichkeit verbundene Verpflichtung zu Kapital- und Zinszahlungen nicht erfüllen kann, und können infolge von Faktoren wie der Zinssensitivität, der Beurteilung der Kreditwürdigkeit des Emittenten durch den Markt und der allgemeinen Marktliquidität (Marktrisiko) Preisschwankungen unterliegen. Festverzinsliche Wertpapiere unterliegen ferner dem Risiko, dass ihr Bonitätsrating oder das ihrer Emittenten herabgesetzt wird, was einen erheblichen Wertverlust solcher Wertpapiere zur Folge haben kann.

Wertpapiere mit niedrigem Rating (Non-Investment-Grade oder High Yield) oder Wertpapiere ohne Rating reagieren mit größerer Wahrscheinlichkeit auf Entwicklungen, die den Markt und das Kreditrisiko beeinflussen, als Wertpapiere mit höheren Ratings, die vor allem auf Veränderungen des allgemeinen Zinsniveaus reagieren. Anleger sollten die relativen Risiken einer Anlage in Hochzinspapieren sorgfältig analysieren und verstehen, dass solche Wertpapiere grundsätzlich nicht für eine kurzfristige Anlage geeignet sind. Anleger, die in einer anderen Währung als der Basiswährung des Fonds zeichnen, sind einem Währungsrisiko ausgesetzt. Schwankungen dieser Wechselkurse können die Kapitalrendite beeinträchtigen.

Die Performance in der Vergangenheit ist kein Indikator für künftige Ergebnisse. Einzelheiten zu den Anlagerisiken, insbesondere zum Liquiditäts-, Zins-, Kredit- und Währungsrisiko, sind dem aktuellen Verkaufsprospekt zu entnehmen. Bitte beachten Sie, dass Dividenden/Zinsen, die der Fonds vereinnahmt, Quellensteuern unterliegen können. Die Benchmark berücksichtigt keine steuerlichen Auswirkungen, und deshalb wurde dieser Abzug nicht in der hierin angegebenen Benchmarkrendite berücksichtigt. Das Anlageziel und die Performancebenchmark sind nur ein Ziel und keine Garantie für die Wertentwicklung des Fonds. Der Index wird nicht gemanagt und ein direktes Investment in diesen ist nicht möglich. Indexrenditen gehen von einer Wiederanlage von Dividenden und Veräußerungsgewinnen aus und berücksichtigen im Gegensatz zu Fondsrenditen keine Gebühren oder Kosten. Nachteilige Veränderungen der Wechselkurse können zu einer Verringerung der Rendite und einem Kapitalverlust führen. Die Anlagen jedes Portfolios können vollständig gegenüber seiner Basiswährung abgesichert sein, was die Währungsrisiken reduzieren, das Portfolio aber anderen Risiken aussetzen kann – wie etwa einem Ausfall einer Gegenpartei. Wie vorstehend erwähnt, sind weitere Informationen zu den spezifischen mit dieser Strategie verbundenen Risiken dem aktuellen Verkaufsprospekt zu entnehmen.

Neuberger Berman ist eine eingetragene Marke.

© 2024 Neuberger Berman